

Aコース（為替ヘッジあり・毎月）

Bコース（為替ヘッジなし・毎月）

Cコース（為替ヘッジあり・年2回）

Dコース（為替ヘッジなし・年2回）

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券
信託期間	2017年11月30日から無期限です。
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、主に米ドル建て債券に分散投資を行い、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	投資信託証券（外国籍投資信託証券および国内投資信託証券（親投資信託を含みます。）を含みます。）を主要な投資対象とします。 ・ケイマン籍外国投資信託「マニユライフ・インベストメント・トラストーU.S.コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジありクラス／円建て為替ヘッジなしクラス）」の受益証券 ・国内籍親投資信託「マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド」の受益証券
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ③同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託会社が基準価額の水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

運用報告書（全体版）

Aコース（為替ヘッジあり・毎月）／

Bコース（為替ヘッジなし・毎月）

第61期（決算日 2022年12月15日）

第62期（決算日 2023年1月16日）

第63期（決算日 2023年2月15日）

第64期（決算日 2023年3月15日）

第65期（決算日 2023年4月17日）

第66期（決算日 2023年5月15日）

Cコース（為替ヘッジあり・年2回）／

Dコース（為替ヘッジなし・年2回）

第11期（決算日 2023年5月15日）

－受益者のみなさまへ－

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「マニユライフ・米国投資適格債券戦略ファンド Aコース（為替ヘッジあり・毎月）／Bコース（為替ヘッジなし・毎月）」は第66期、「マニユライフ・米国投資適格債券戦略ファンド Cコース（為替ヘッジあり・年2回）／Dコース（為替ヘッジなし・年2回）」は第11期の決算を行いました。ここに、各期中の運用状況をご報告申し上げます。今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

マニユライフ・インベストメント・マネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-1 丸の内トラストタワーN館

お問い合わせ先

サポートダイヤル：03-6267-1901

受付時間：営業日の午前9時～午後5時

ホームページアドレス：www.manulifeim.co.jp/

【Aコース】

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			参考指数		株式組入比率	債券組入比率	投資信託証券比率	純資産総額	
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率		騰落率					
第7作成期	37期（2020年12月15日）	円 10,002	円 10	% 0.5		% 11,673	0.5	% —	0.0	96.0	百万円 1,343
	38期（2021年1月15日）	9,906	10	△0.9	11,598	△0.6	—	0.0	96.1	801	
	39期（2021年2月15日）	9,877	10	△0.2	11,558	△0.3	—	0.0	96.3	798	
	40期（2021年3月15日）	9,667	10	△2.0	11,311	△2.1	—	0.0	96.0	1,194	
	41期（2021年4月15日）	9,689	10	0.3	11,383	0.6	—	0.0	96.2	1,197	
	42期（2021年5月17日）	9,701	10	0.2	11,386	0.0	—	0.0	96.4	1,199	
第8作成期	43期（2021年6月15日）	9,755	10	0.7	11,477	0.8	—	0.0	96.5	1,206	
	44期（2021年7月15日）	9,808	10	0.6	11,574	0.8	—	0.0	96.7	1,213	
	45期（2021年8月16日）	9,800	10	0.0	11,607	0.3	—	0.0	96.9	1,212	
	46期（2021年9月15日）	9,833	10	0.4	11,662	0.5	—	0.0	97.1	1,216	
	47期（2021年10月15日）	9,691	10	△1.3	11,530	△1.1	—	0.0	96.2	1,102	
	48期（2021年11月15日）	9,642	10	△0.4	11,504	△0.2	—	0.0	96.0	1,100	
第9作成期	49期（2021年12月15日）	9,635	10	0.0	11,531	0.2	—	0.0	96.1	1,100	
	50期（2022年1月17日）	9,453	10	△1.8	11,312	△1.9	—	0.0	96.1	1,128	
	51期（2022年2月15日）	9,231	10	△2.2	11,065	△2.2	—	0.0	96.2	1,102	
	52期（2022年3月15日）	9,009	10	△2.3	10,868	△1.8	—	0.0	96.2	1,076	
	53期（2022年4月15日）	8,703	10	△3.3	10,538	△3.0	—	0.0	96.3	1,040	
	54期（2022年5月16日）	8,551	10	△1.6	10,403	△1.3	—	0.0	96.4	1,022	
第10作成期	55期（2022年6月15日）	8,254	10	△3.4	10,065	△3.3	—	0.0	96.4	987	
	56期（2022年7月15日）	8,414	10	2.1	10,359	2.9	—	0.0	96.6	1,007	
	57期（2022年8月15日）	8,492	10	1.0	10,498	1.3	—	0.0	95.9	1,043	
	58期（2022年9月15日）	8,195	10	△3.4	10,131	△3.5	—	0.0	96.0	1,007	
	59期（2022年10月17日）	7,792	10	△4.8	9,697	△4.3	—	0.0	95.9	958	
	60期（2022年11月15日）	7,859	10	1.0	9,879	1.9	—	0.0	96.1	967	
第11作成期	61期（2022年12月15日）	8,116	10	3.4	10,258	3.8	—	0.0	96.4	999	
	62期（2023年1月16日）	8,110	10	0.0	10,298	0.4	—	0.0	96.4	1,000	
	63期（2023年2月15日）	8,017	10	△1.0	10,167	△1.3	—	0.0	96.0	1,302	
	64期（2023年3月15日）	7,959	10	△0.6	10,182	0.1	—	0.0	96.2	1,293	
	65期（2023年4月17日）	7,985	10	0.5	10,320	1.4	—	0.0	96.4	1,298	
	66期（2023年5月15日）	7,958	10	△0.2	10,353	0.3	—	0.0	96.5	1,294	

（注1）基準価額は1万円当たり、騰落率は分配金込みです。

（注2）当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ米国総合債券インデックス（米ドルベース）（以下Aコースにおいて、参考指数といいます。）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

（注3）当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

参考指数に関して

ブルームバーグ米国総合債券インデックスは、米ドル建て投資適格債券市場のパフォーマンスを表します。

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		参 考 指 数		株 式 組 入 比 率	債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 比 率
		騰 落 率	騰 落 率					
第61期	(期 首) 2022年11月15日	円 7,859	% —	9,879	% —	% —	% 0.0	% 96.1
	11月末	7,961	1.3	10,007	1.3	—	0.0	96.2
	(期 末) 2022年12月15日	8,126	3.4	10,258	3.8	—	0.0	96.4
第62期	(期 首) 2022年12月15日	8,116	—	10,258	—	—	0.0	96.4
	12月末	7,945	△2.1	10,046	△2.1	—	0.0	96.2
	(期 末) 2023年1月16日	8,120	0.0	10,298	0.4	—	0.0	96.4
第63期	(期 首) 2023年1月16日	8,110	—	10,298	—	—	0.0	96.4
	1月末	8,128	0.2	10,293	△0.0	—	0.0	96.5
	(期 末) 2023年2月15日	8,027	△1.0	10,167	△1.3	—	0.0	96.0
第64期	(期 首) 2023年2月15日	8,017	—	10,167	—	—	0.0	96.0
	2月末	7,919	△1.2	10,057	△1.1	—	0.0	96.0
	(期 末) 2023年3月15日	7,969	△0.6	10,182	0.1	—	0.0	96.2
第65期	(期 首) 2023年3月15日	7,959	—	10,182	—	—	0.0	96.2
	3月末	7,988	0.4	10,272	0.9	—	0.0	96.2
	(期 末) 2023年4月17日	7,995	0.5	10,320	1.4	—	0.0	96.4
第66期	(期 首) 2023年4月17日	7,985	—	10,320	—	—	0.0	96.4
	4月末	7,982	△0.0	10,325	0.0	—	0.0	96.3
	(期 末) 2023年5月15日	7,968	△0.2	10,353	0.3	—	0.0	96.5

(注1) 騰落率は期首比です。(期末基準価額は分配金を含みます。)

(注2) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

(注3) 当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ米国総合債券インデックス(米ドルベース)です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

【Bコース】

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			参考指数		株式組入比率	債券組入比率	投資信託証券比率	純資産総額	
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率		騰落率					
第7作成期	37期（2020年12月15日）	円 9,599	円 20	% 0.0		% 10,889	% △0.0	% —	% 0.0	% 96.7	百万円 560
	38期（2021年1月15日）	9,501	20	△0.8	10,790	△0.9	—	0.0	96.9	555	
	39期（2021年2月15日）	9,565	20	0.9	10,885	0.9	—	0.0	96.1	1,058	
	40期（2021年3月15日）	9,677	20	1.4	11,051	1.5	—	0.0	96.9	1,004	
	41期（2021年4月15日）	9,690	20	0.3	11,107	0.5	—	0.0	96.2	1,015	
	42期（2021年5月17日）	9,731	20	0.6	11,165	0.5	—	0.0	96.3	922	
第8作成期	43期（2021年6月15日）	9,844	20	1.4	11,322	1.4	—	0.0	96.3	936	
	44期（2021年7月15日）	9,877	20	0.5	11,398	0.7	—	0.0	96.2	943	
	45期（2021年8月16日）	9,843	20	△0.1	11,387	△0.1	—	0.0	96.0	1,036	
	46期（2021年9月15日）	9,875	20	0.5	11,456	0.6	—	0.0	96.6	1,036	
	47期（2021年10月15日）	10,070	20	2.2	11,764	2.7	—	0.0	96.3	986	
	48期（2021年11月15日）	10,042	20	△0.1	11,749	△0.1	—	0.0	96.3	986	
第9作成期	49期（2021年12月15日）	10,014	20	△0.1	11,756	0.1	—	0.0	96.1	988	
	50期（2022年1月17日）	9,865	20	△1.3	11,587	△1.4	—	0.0	95.6	980	
	51期（2022年2月15日）	9,727	20	△1.2	11,442	△1.3	—	0.0	95.9	966	
	52期（2022年3月15日）	9,689	20	△0.2	11,513	0.6	—	0.0	96.1	963	
	53期（2022年4月15日）	9,973	20	3.1	11,931	3.6	—	0.0	95.9	998	
	54期（2022年5月16日）	10,045	20	0.9	12,083	1.3	—	0.0	96.2	1,005	
第10作成期	55期（2022年6月15日）	10,138	20	1.1	12,174	0.7	—	0.0	96.5	1,014	
	56期（2022年7月15日）	10,596	20	4.7	12,894	5.9	—	0.0	96.0	1,026	
	57期（2022年8月15日）	10,327	20	△2.3	12,506	△3.0	—	0.0	95.7	1,005	
	58期（2022年9月15日）	10,669	20	3.5	13,010	4.0	—	0.0	96.1	1,038	
	59期（2022年10月17日）	10,551	20	△0.9	12,910	△0.8	—	0.0	96.3	1,027	
	60期（2022年11月15日）	10,079	20	△4.3	12,427	△3.7	—	0.0	96.3	981	
第11作成期	61期（2022年12月15日）	10,112	20	0.5	12,450	0.2	—	0.0	97.5	976	
	62期（2023年1月16日）	9,581	20	△5.1	11,801	△5.2	—	0.0	97.6	925	
	63期（2023年2月15日）	9,866	20	3.2	12,095	2.5	—	0.0	96.5	754	
	64期（2023年3月15日）	9,909	20	0.6	12,280	1.5	—	0.0	96.8	757	
	65期（2023年4月17日）	9,940	20	0.5	12,379	0.8	—	0.0	97.1	759	
	66期（2023年5月15日）	10,086	20	1.7	12,619	1.9	—	0.0	97.4	770	

（注1）基準価額は1万円当たり、騰落率は分配金込みです。

（注2）当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ米国総合債券インデックス（円換算ベース／三菱UFJ銀行T T M）（以下Bコースにおいて、参考指数といいます。）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

（注3）当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

参考指数に関して

ブルームバーグ米国総合債券インデックスは、米ドル建て投資適格債券市場のパフォーマンスを表します。

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準 価 額		参 考 指 数		株 式 組 入 比 率	債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 比 率
		騰 落 率	騰 落 率					
第61期	(期 首) 2022年11月15日	円 10,079	% —	12,427	% —	% —	% 0.0	% 96.3
	11月末	10,135	0.6	12,451	0.2	—	0.0	96.4
	(期 末) 2022年12月15日	10,132	0.5	12,450	0.2	—	0.0	97.5
第62期	(期 首) 2022年12月15日	10,112	—	12,450	—	—	0.0	97.5
	12月末	9,739	△3.7	11,944	△4.1	—	0.0	97.4
	(期 末) 2023年1月16日	9,601	△5.1	11,801	△5.2	—	0.0	97.6
第63期	(期 首) 2023年1月16日	9,581	—	11,801	—	—	0.0	97.6
	1月末	9,809	2.4	12,031	1.9	—	0.0	96.1
	(期 末) 2023年2月15日	9,886	3.2	12,095	2.5	—	0.0	96.5
第64期	(期 首) 2023年2月15日	9,866	—	12,095	—	—	0.0	96.5
	2月末	9,984	1.2	12,284	1.6	—	0.0	96.5
	(期 末) 2023年3月15日	9,929	0.6	12,280	1.5	—	0.0	96.8
第65期	(期 首) 2023年3月15日	9,909	—	12,280	—	—	0.0	96.8
	3月末	9,864	△0.5	12,288	0.1	—	0.0	96.8
	(期 末) 2023年4月17日	9,960	0.5	12,379	0.8	—	0.0	97.1
第66期	(期 首) 2023年4月17日	9,940	—	12,379	—	—	0.0	97.1
	4月末	9,978	0.4	12,407	0.2	—	0.0	97.1
	(期 末) 2023年5月15日	10,106	1.7	12,619	1.9	—	0.0	97.4

(注1) 騰落率は期首比です。(期末基準価額は分配金を含みます。)

(注2) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

(注3) 当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ米国総合債券インデックス（円換算ベース／三菱UFJ銀行T T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

【Cコース】

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			参考指数		株式組入比率	債券組入比率	投資信託証券比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	騰落率	騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
7期(2021年5月17日)	10,112	0	△2.0	11,386	△2.0	—	0.0	97.7	1,398
8期(2021年11月15日)	10,115	0	0.0	11,504	1.0	—	0.0	96.6	1,224
9期(2022年5月16日)	9,027	0	△10.8	10,403	△9.6	—	0.0	96.5	914
10期(2022年11月15日)	8,360	0	△7.4	9,879	△5.0	—	0.0	96.5	956
11期(2023年5月15日)	8,529	0	2.0	10,353	4.8	—	0.0	96.6	684

(注1) 基準価額は1万口当たり、騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ米国総合債券インデックス（米ドルベース）（以下Cコースにおいて、参考指数といいまします。）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

参考指数に関して

ブルームバーグ米国総合債券インデックスは、米ドル建て投資適格債券市場のパフォーマンスを表します。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数		株式組入比率	債券組入比率	投資信託証券比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首) 2022年11月15日	円	%		%	%	%	%
	8,360	—	9,879	—	—	0.0	96.5
11月末	8,469	1.3	10,007	1.3	—	0.0	96.0
12月末	8,462	1.2	10,046	1.7	—	0.0	95.0
2023年1月末	8,668	3.7	10,293	4.2	—	0.0	97.2
2月末	8,451	1.1	10,057	1.8	—	0.0	96.4
3月末	8,535	2.1	10,272	4.0	—	0.0	96.5
4月末	8,545	2.2	10,325	4.5	—	0.0	93.1
(期末) 2023年5月15日	8,529	2.0	10,353	4.8	—	0.0	96.6

(注1) 騰落率は期首比です。（期末基準価額は分配金を含みます。）

(注2) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

(注3) 当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ米国総合債券インデックス（米ドルベース）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

【Dコース】

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			参考指数		株式組入比率	債券組入比率	投資信託証券比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	騰落率	騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
7期(2021年5月17日)	10,609	0	2.7	11,165	2.5	—	0.0	96.0	840
8期(2021年11月15日)	11,081	0	4.4	11,749	5.2	—	0.0	96.5	774
9期(2022年5月16日)	11,217	0	1.2	12,083	2.8	—	0.0	96.4	762
10期(2022年11月15日)	11,372	0	1.4	12,427	2.8	—	0.0	96.4	666
11期(2023年5月15日)	11,526	0	1.4	12,619	1.5	—	0.0	96.3	430

(注1) 基準価額は1万円当たり、騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ米国総合債券インデックス（円換算ベース／三菱UFJ銀行T T M）（以下Dコースにおいて、参考指数といいます。）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

参考指数に関して

ブルームバーグ米国総合債券インデックスは、米ドル建て投資適格債券市場のパフォーマンスを表します。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数		株式組入比率	債券組入比率	投資信託証券比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首) 2022年11月15日	円	%		%	%	%	%
	11,372	—	12,427	—	—	0.0	96.4
11月末	11,436	0.6	12,451	0.2	—	0.0	96.6
12月末	11,015	△3.1	11,944	△3.9	—	0.0	95.6
2023年1月末	11,119	△2.2	12,031	△3.2	—	0.0	95.5
2月末	11,339	△0.3	12,284	△1.1	—	0.0	96.3
3月末	11,225	△1.3	12,288	△1.1	—	0.0	96.3
4月末	11,375	0.0	12,407	△0.2	—	0.0	96.4
(期末) 2023年5月15日	11,526	1.4	12,619	1.5	—	0.0	96.3

(注1) 騰落率は期首比です。（期末基準価額は分配金を含みます。）

(注2) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

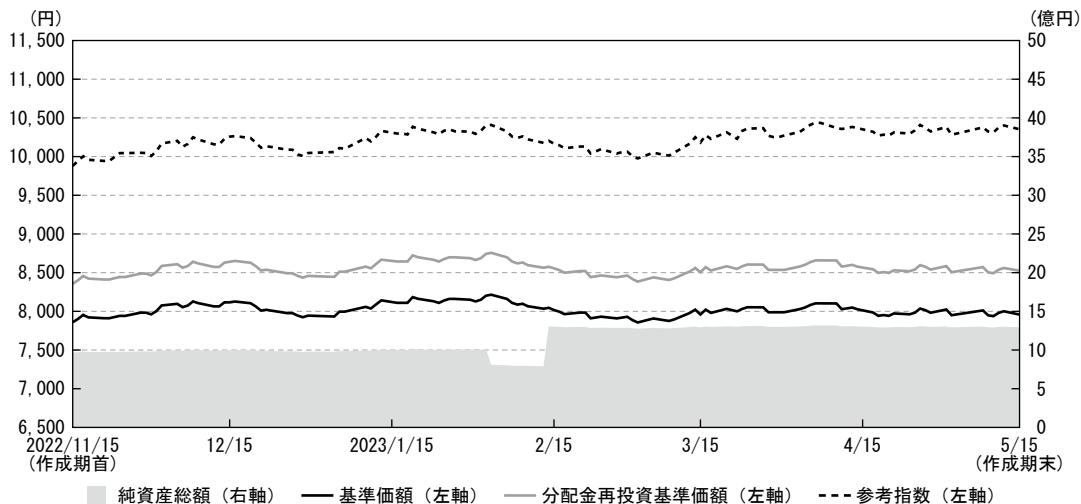
(注3) 当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ米国総合債券インデックス（円換算ベース／三菱UFJ銀行T T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

運用経過

■基準価額等の推移（2022年11月16日から2023年5月15日まで）

Aコース



作成期首：7,859円

作成期末：7,958円（既払分配金60円）

騰落率：2.0%（分配金再投資ベース）

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資（複利運用）したものととして、委託会社が算出したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ米国総合債券インデックス（米ドルベース）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

※分配金を再投資するかどうかについては、お客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益状況を示すものではありません。

■基準価額の主な変動要因

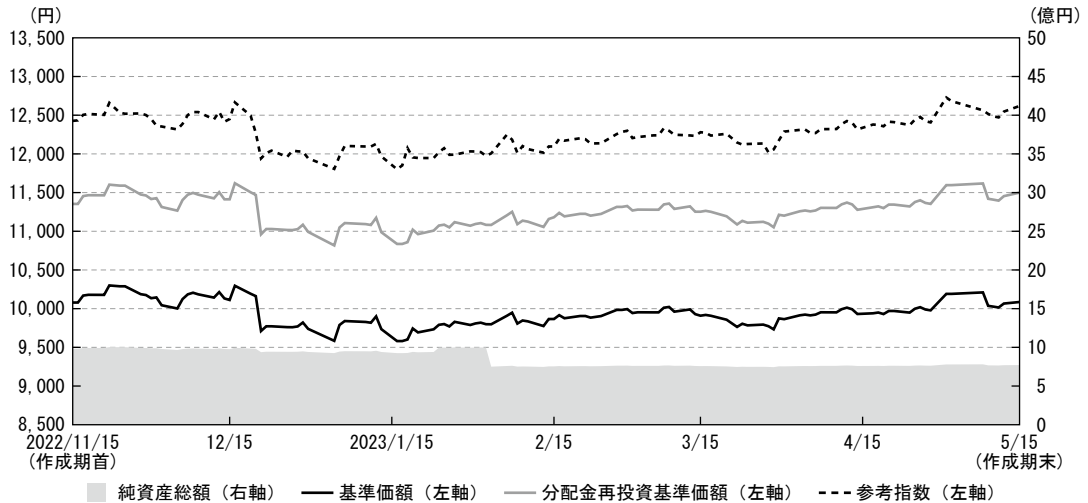
- ・安定的な利息収入がプラスに寄与しました。
- ・米国長期金利の低下がプラスに寄与しました。
- ・為替ヘッジ取引にかかるコスト（ヘッジコスト）がマイナスに寄与しました。

◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュアル・インベストメンツ・トラスト-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジありクラス）	2.5%
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	0.5%

■基準価額等の推移（2022年11月16日から2023年5月15日まで）

Bコース



作成期首：10,079円

作成期末：10,086円（既払分配金120円）

騰落率： 1.3%（分配金再投資ベース）

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資（複利運用）したものととして、委託会社が算出したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ米国総合債券インデックス（円換算ベース／三菱UFJ銀行T T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

※分配金を再投資するかどうかについては、お客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益状況を示すものではありません。

■基準価額の主な変動要因

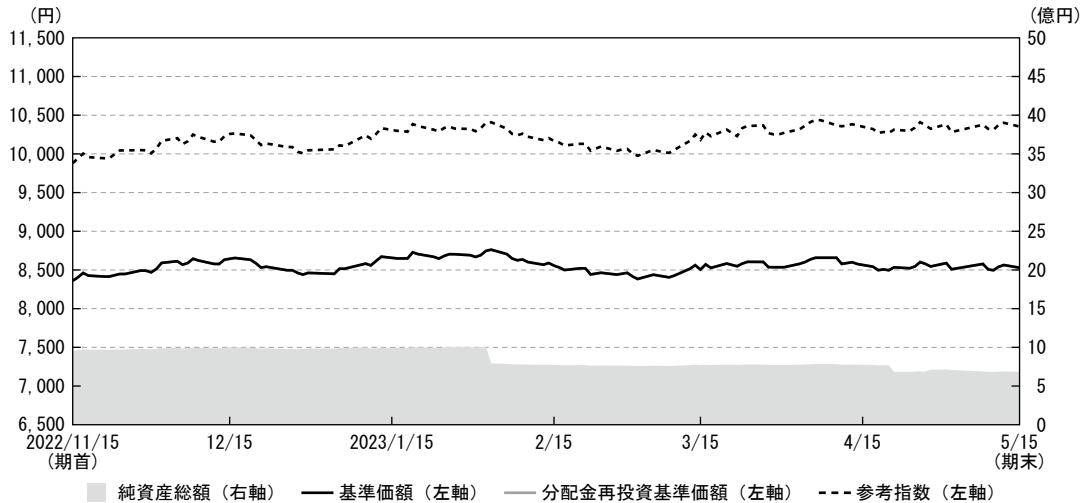
- ・安定的な利息収入がプラスに寄与しました。
- ・米国長期金利の低下がプラスに寄与しました。
- ・円が米ドルに対し上昇したことがマイナスに寄与しました。

◆当作成期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュアル・インベストメンツ・トラスト-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジなしクラス）	1.9%
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	0.5%

■基準価額等の推移（2022年11月16日から2023年5月15日まで）

Cコース



期 首：8,360円

期 末：8,529円（既払分配金0円）

騰落率： 2.0%（分配金再投資ベース）

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資（複利運用）したものととして、委託会社が算出したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ米国総合債券インデックス（米ドルベース）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

※分配金を再投資するかどうかについては、お客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益状況を示すものではありません。

■基準価額の主な変動要因

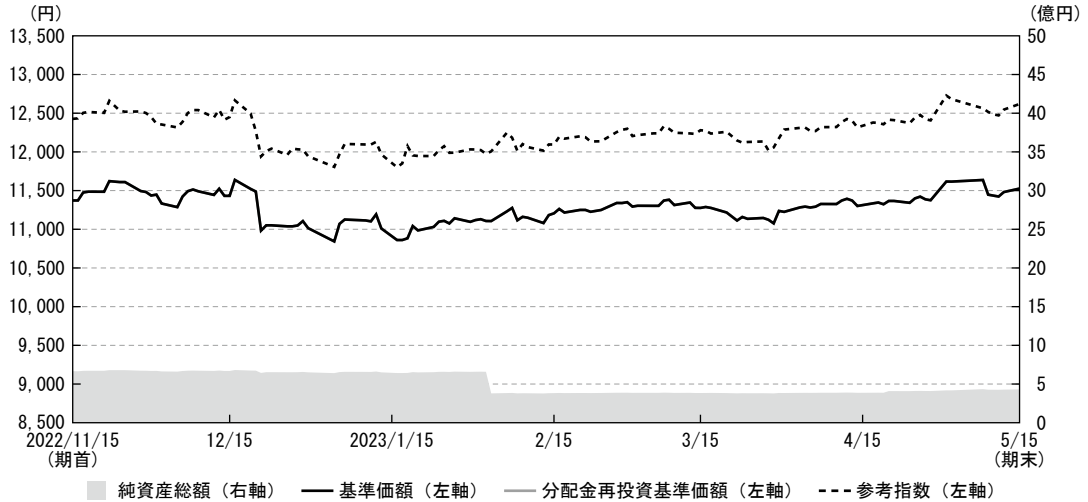
- ・安定的な利息収入がプラスに寄与しました。
- ・米国長期金利の低下がプラスに寄与しました。
- ・為替ヘッジ取引にかかるコスト（ヘッジコスト）がマイナスに寄与しました。

◆当期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュライフ・インベストメンツ・トラスト-US・コア・フィクسد・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジありクラス）	2.5%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.5%

■基準価額等の推移（2022年11月16日から2023年5月15日まで）

Dコース



期首：11,372円

期末：11,526円（既払分配金0円）

騰落率：1.4%（分配金再投資ベース）

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資（複利運用）したものととして、委託会社が算出したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ米国総合債券インデックス（円換算ベース／三菱UFJ銀行T T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

※分配金を再投資するかどうかについては、お客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益状況を示すものではありません。

■基準価額の主な変動要因

- ・安定的な利息収入がプラスに寄与しました。
- ・米国長期金利の低下がプラスに寄与しました。
- ・円が米ドルに対し上昇したことがマイナスに寄与しました。

◆当期間の組入ファンドの騰落率

組入ファンド	騰落率
マニュアル・インベストメンツ・トラスト-US・コア・フィクسد・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジなしクラス）	1.9%
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	0.5%

■投資環境

[債券市況]

全コース共通

米10年国債利回りは、期初に3.8%台で始まった後、政策金利の引上げ停止の時期が近いとの観測などから低下、3.4%台で期を終えました。米投資適格債券は、米長期金利の低下などを背景に上昇しました（トータルリターンベース）。

[為替市況]

Bコース／Dコース

外国為替市場では、円は米ドルに対して上昇（円高）しました。期初1米ドル140円台で始まった後、米長期金利の低下や政策金利の引上げ停止の時期が近いとの観測などが米ドル売り要因となり、当期末には136円台となりました。

[日本債券市況]

全コース共通

当期間の10年国債利回りは、期初0.240%から期末0.405%となり利回りは上昇しました。

■当該投資信託のポートフォリオ

Aコース／Cコース

主要投資対象とするケイマン籍外国投資信託「マニユライフ・インベストメンツ・トラストーUS・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジありクラス）」（以下「MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジありクラス）」といいます。）の組入比率は高位に維持しました。

また、円建て為替ヘッジありクラスに投資を行うことで、円に対する米ドルの為替ヘッジ取引を活用し、為替リスクの低減を図っています。

Bコース／Dコース

主要投資対象とするケイマン籍外国投資信託「マニユライフ・インベストメンツ・トラストーUS・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジなしクラス）」（以下「MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジなしクラス）」といいます。）の組入比率は高位に維持しました。

MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジありクラス／円建て為替ヘッジなしクラス）

当該投資信託証券を通じて主に米ドル建ての債券等に分散投資を行うことにより、トータル・リターンの最大化をめざして運用を行いました。

原則として、円建て為替ヘッジありクラスは、対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。円建て為替ヘッジなしクラスは、対円での為替ヘッジを行いません。

マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド

NOMURA-BPI総合に採用されている公社債に投資することにより、同インデックスの動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

Aコース

組入ファンド・資産	比率
MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジありクラス）	96.5%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.0%
現預金等	3.5%
合計	100.0%

Bコース

組入ファンド・資産	比率
MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジなしクラス）	97.4%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.0%
現預金等	2.6%
合計	100.0%

Cコース

組入ファンド・資産	比率
MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジありクラス）	96.6%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.0%
現預金等	3.4%
合計	100.0%

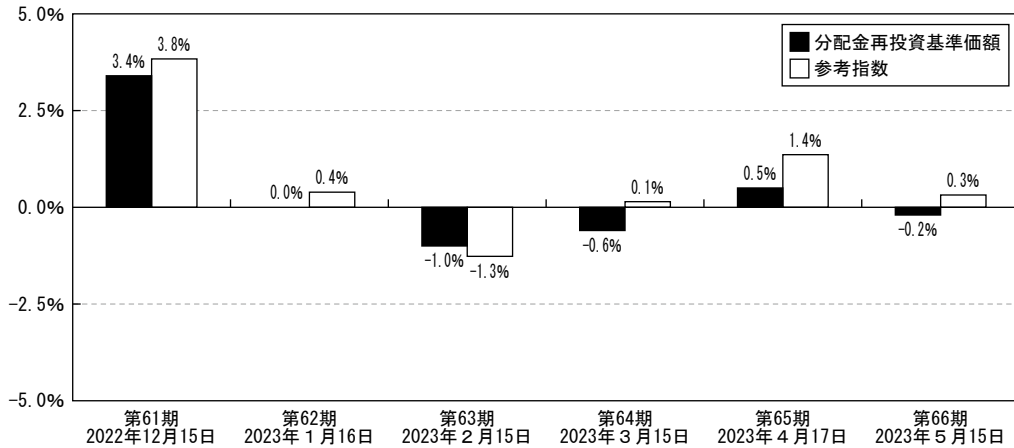
Dコース

組入ファンド・資産	比率
MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジなしクラス）	96.3%
マニュライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	0.0%
現預金等	3.7%
合計	100.0%

■当該投資信託のベンチマークとの差異

Aコース

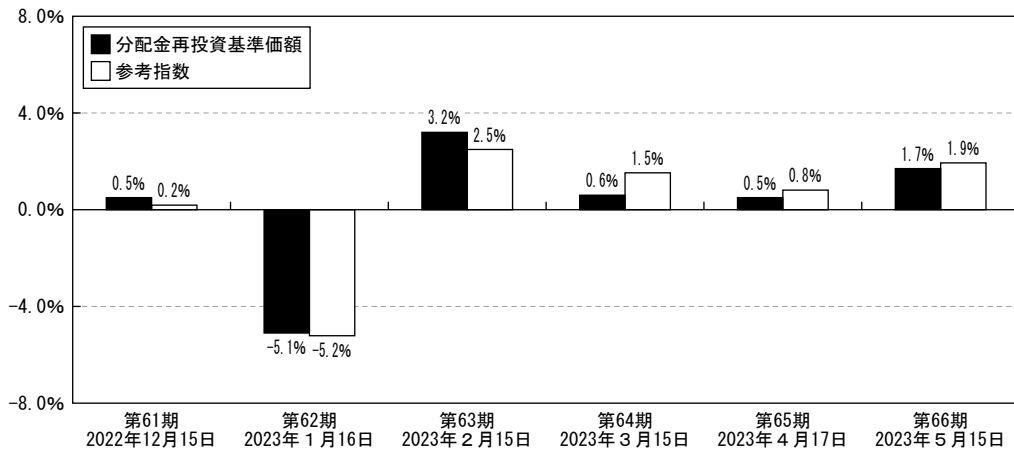
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ米国総合債券インデックス（米ドルベース）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

Bコース

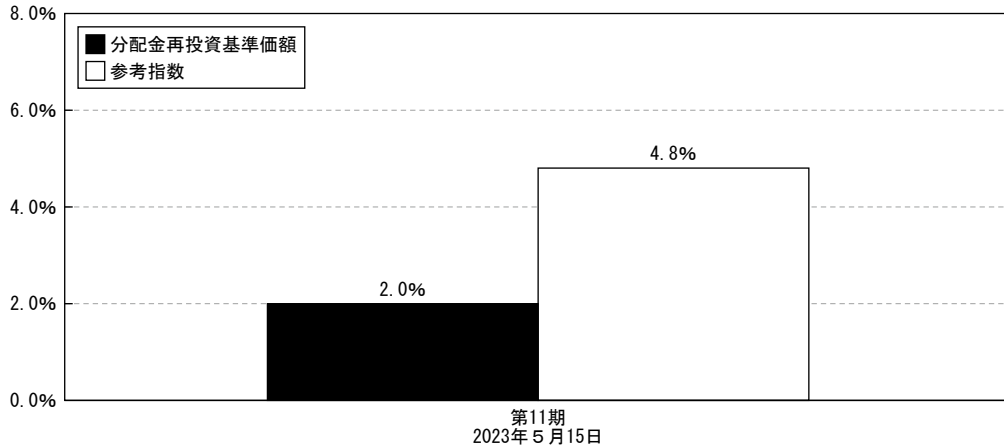
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ米国総合債券インデックス（円換算ベース／三菱UFJ銀行T T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

Cコース

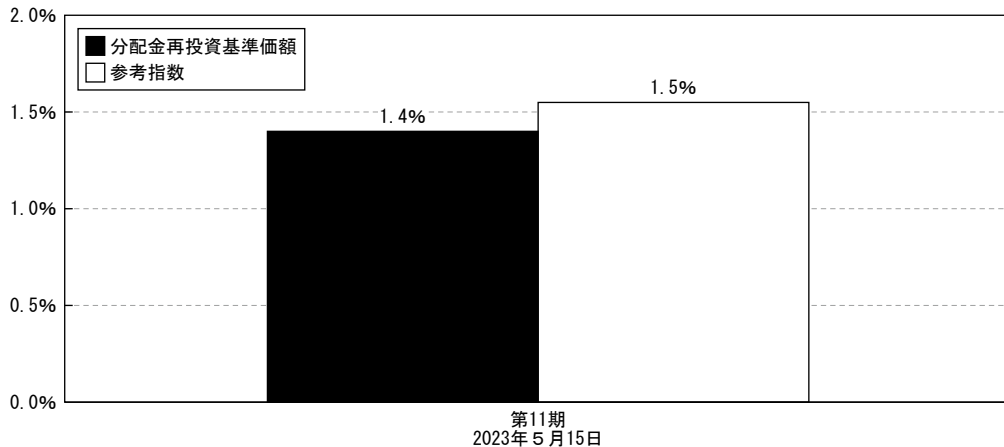
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ米国総合債券インデックス（米ドルベース）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

Dコース

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



※当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ米国総合債券インデックス（円換算ベース／三菱UFJ銀行T T M）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

■収益分配金について

Aコース

当作成期間の収益分配は、分配方針に基づき第61期～第66期は10円、合計60円（1万口当たり、税引前）とさせていただきます。留保益の運用については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。

[分配原資の内訳]

（1万口当たり、税引前）

	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期
	自 2022年11月16日 至 2022年12月15日	自 2022年12月16日 至 2023年1月16日	自 2023年1月17日 至 2023年2月15日	自 2023年2月16日 至 2023年3月15日	自 2023年3月16日 至 2023年4月17日	自 2023年4月18日 至 2023年5月15日
当期分配金 (円)	10	10	10	10	10	10
(対基準価額比率) (%)	0.123	0.123	0.125	0.125	0.125	0.126
当期の収益 (円)	—	—	—	—	—	—
当期の収益以外 (円)	10	10	10	10	10	10
翌期繰越分配対象額 (円)	954	969	985	1,001	1,018	1,034

(注1) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。

また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注3) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

Bコース

当作成期間の収益分配は、分配方針に基づき第61期～第66期は20円、合計120円（1万口当たり、税引前）とさせていただきます。留保益の運用については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。

[分配原資の内訳]

（1万口当たり、税引前）

	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期
	自 2022年11月16日 至 2022年12月15日	自 2022年12月16日 至 2023年1月16日	自 2023年1月17日 至 2023年2月15日	自 2023年2月16日 至 2023年3月15日	自 2023年3月16日 至 2023年4月17日	自 2023年4月18日 至 2023年5月15日
当期分配金 (円)	20	20	20	20	20	20
(対基準価額比率) (%)	0.197	0.208	0.202	0.201	0.201	0.198
当期の収益 (円)	19	19	—	—	—	13
当期の収益以外 (円)	0	0	20	20	20	6
翌期繰越分配対象額 (円)	1,302	1,304	1,314	1,321	1,327	1,336

(注1) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。

また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注3) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

Cコース

第11期の収益分配につきましては、基準価額水準・市況動向等を勘案した結果、分配金のお支払いは見送りとさせていただきます。留保益の運用については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。

[分配原資の内訳]

(1万口当たり、税引前)

		第11期	
		自 2022年11月16日 至 2023年5月15日	
当期分配金	(円)	—	
(対基準価額比率)	(%)	—	
当期の収益	(円)	—	
当期の収益以外	(円)	—	
翌期繰越分配対象額	(円)	1,567	

(注1) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注3) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税込み)に合致しない場合があります。

Dコース

第11期の収益分配につきましては、基準価額水準・市況動向等を勘案した結果、分配金のお支払いは見送りとさせていただきます。留保益の運用については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。

[分配原資の内訳]

(1万口当たり、税引前)

		第11期	
		自 2022年11月16日 至 2023年5月15日	
当期分配金	(円)	—	
(対基準価額比率)	(%)	—	
当期の収益	(円)	—	
当期の収益以外	(円)	—	
翌期繰越分配対象額	(円)	1,980	

(注1) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注3) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税込み)に合致しない場合があります。

■今後の運用方針

Aコース／Cコース

「MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジありクラス）」への投資を通じて主に米ドル建て債券に分散投資を行い、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。

また、円建て為替ヘッジありクラスに投資を行うことで、円に対する米ドルの為替ヘッジ取引を活用し、為替リスクの低減を図る方針です。

Bコース／Dコース

「MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジなしクラス）」への投資を通じて主に米ドル建て債券に分散投資を行い、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。

MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジありクラス／円建て為替ヘッジなしクラス）

インフレの鈍化とともに、主要中央銀行の金融引締めサイクルは終わりに近づきつつあると見られますが、積極的な利上げの影響が中期的には今後、住宅、雇用、消費などに重くのしかかり、世界経済の減速リスクは高まると考えられます。市場では、インフレ率などの経済指標、中央銀行の金融政策、ウクライナ情勢などをめぐり、高いボラティリティ（価格変動性）が続くと思われま。投資適格債券は、引き続き投資機会があると考えていますが、クレジット市場のファンダメンタルズの悪化とともにデフォルト（債務不履行）率の上昇が考えられることから、業種、格付け、発行体によるパフォーマンス差に留意し、相対的に質の高い証券への投資を行い、保守的なポートフォリオを維持する方針です。当ファンドでは引き続き米国債、投資適格社債、資産担保証券等への配分を機動的に行いながら、着実なインカムの獲得を通じて中長期的に安定した投資成果をめざします。

マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド

NOMURA-BPI総合に採用されている公社債に投資することにより、同インデックスの動きに連動する投資成果をめざす方針です。

【Aコース】

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第61期～第66期 (2022年11月16日～2023年5月15日)		項目の概要
	金額	比率	
	平均基準価額	7,987円	
(a) 信託報酬 （投信会社） （販売会社） （受託会社）	34円 (11) (22) (1)	0.423% (0.136) (0.273) (0.014)	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 ・委託した資金の運用の対価 ・交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(d) 有価証券取引税	—	—	(d) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(e) その他費用 （監査費用） （印刷） （その他）	3 (1) (2) (0)	0.040 (0.011) (0.027) (0.002)	(e) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 その他費用 ・監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ・印刷は、印刷会社等に支払う法定書類の作成等に係る費用 ・その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	37	0.463	

* 作成期間の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

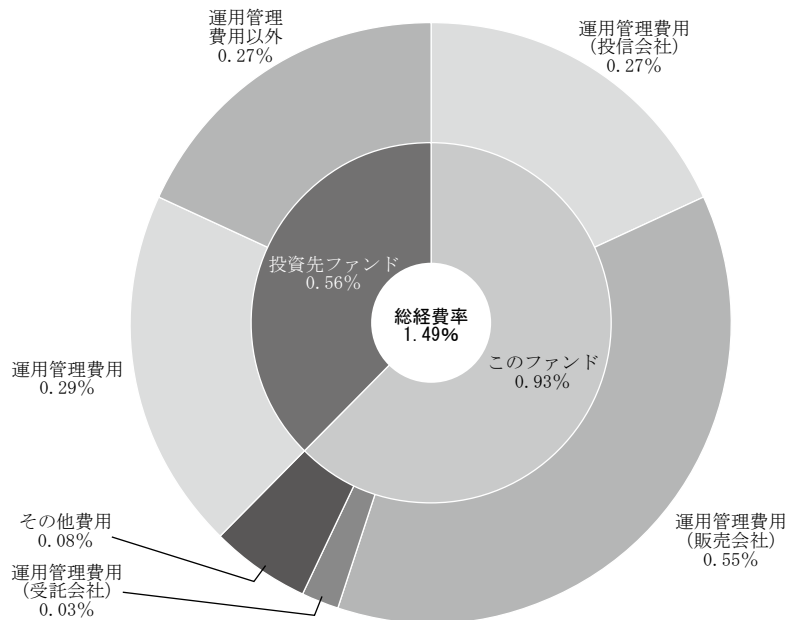
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（参考情報）

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.49%です。



総経費率 (①+②+③)	1.49%
①このファンドの費用の比率	0.93%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.29%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.27%

- *①の費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
- *各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。
- *各比率は、年率換算した値です。
- *投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
- *①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
- *①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
- *上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

■売買及び取引の状況（2022年11月16日から2023年5月15日まで）
投資信託証券

決 算 期 銘 柄 名	第 61 期 ～ 第 66 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国（ケイマン諸島） MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジありクラス）	口	千円	口	千円
	709,266	517,692	265,536	199,418

（注1）金額は受渡代金です。

（注2）口数・金額の単位未満は切り捨てです。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

当作成期において、設定および解約はありません。

■利害関係人との取引状況等（2022年11月16日から2023年5月15日まで）
期中の利害関係人との取引状況

当ファンド

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

（注）利害関係人とは投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■第一種金融商品取引業又は第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己の取引状況
（2022年11月16日から2023年5月15日まで）

該当事項はありません。

■自社による当ファンドの設定・解約状況（2022年11月16日から2023年5月15日まで）
該当事項はありません。

■組入資産の明細（2023年5月15日現在）

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

決 算 期	第 11 作 成 期 末		
銘 柄	口 数	評 価 額	組 入 比 率
(ケイマン諸島)	口	千円	%
MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジありクラス）	1,735,007	1,249,205	96.5
合 計	1,735,007	1,249,205	

(注1) 組入比率は、当作成期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

(2) 親投資信託残高

項 目	第10作成期末	第11作成期末	
	口 数	口 数	評 価 額
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 83	千口 83	千円 98

(注1) マザーファンドの2023年5月15日現在の受益権総口数は7,525,450千口です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

■有価証券の貸付及び借入の状況（2023年5月15日現在）

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

(2023年5月15日現在)

項 目	第 11 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 1,249,205	% 96.3
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	98	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	47,776	3.7
投 資 信 託 財 産 総 額	1,297,079	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨てております。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第61期末 2022年12月15日	第62期末 2023年1月16日	第63期末 2023年2月15日	第64期末 2023年3月15日	第65期末 2023年4月17日	第66期末 2023年5月15日
(A) 資 産	1,001,018,041円	1,002,291,920円	1,796,348,051円	1,296,231,628円	1,301,024,312円	1,297,079,902円
コール・ローン等	37,595,012	37,531,799	545,310,533	52,054,262	49,985,696	47,775,473
投資信託受益証券(評価額)	963,324,977	964,663,958	1,250,940,636	1,244,079,063	1,250,940,630	1,249,205,616
マニュアル・日本債券 インデックス・ マザーファンド(評価額)	98,052	96,163	96,882	98,303	97,986	98,813
(B) 負 債	1,993,422	2,050,138	493,692,548	2,536,399	2,710,100	2,541,069
未 払 金	—	—	491,334,000	—	—	—
未払収益分配金	1,230,887	1,233,270	1,624,867	1,625,416	1,626,006	1,626,635
未払信託報酬	690,100	739,491	658,370	842,604	1,003,713	845,962
その他未払費用	72,435	77,377	75,311	68,379	80,381	68,472
(C) 純資産総額(A－B)	999,024,619	1,000,241,782	1,302,655,503	1,293,695,229	1,298,314,212	1,294,538,833
元 本	1,230,887,720	1,233,270,652	1,624,867,583	1,625,416,265	1,626,006,737	1,626,635,090
次期繰越損益金	△ 231,863,101	△ 233,028,870	△ 322,212,080	△ 331,721,036	△ 327,692,525	△ 332,096,257
(D) 受 益 権 総 口 数	1,230,887,720口	1,233,270,652口	1,624,867,583口	1,625,416,265口	1,626,006,737口	1,626,635,090口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,116円	8,110円	8,017円	7,959円	7,985円	7,958円

(注1) 当ファンドの第61期首元本額は1,230,374,999円、第61～66期中追加設定元本額は650,500,336円、第61～66期中一部解約元本額は254,240,245円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第61期0.8116円、第62期0.8110円、第63期0.8017円、第64期0.7959円、第65期0.7985円、第66期0.7958円です。

(注3) 貸借対照表上の純資産総額が元本総額を下回っており、その差額は、第61期末231,863,101円、第62期末233,028,870円、第63期末322,212,080円、第64期末331,721,036円、第65期末327,692,525円、第66期末332,096,257円です。

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンド監査は終了していません。

■損益の状況

項 目	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期
	自 2022年11月16日 至 2022年12月15日	自 2022年12月16日 至 2023年1月16日	自 2023年1月17日 至 2023年2月15日	自 2023年2月16日 至 2023年3月15日	自 2023年3月16日 至 2023年4月17日	自 2023年4月18日 至 2023年5月15日
(A) 配 当 等 収 益	3,873,834円	3,889,603円	3,108,912円	5,140,852円	5,162,154円	5,183,456円
受 取 配 当 金	3,873,834	3,889,603	3,108,912	5,140,852	5,162,154	5,183,456
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	29,730,691	△ 2,547,758	△ 11,036,439	△ 12,001,004	1,699,096	△ 6,917,643
売 買 益	29,730,926	4,439	2,656,091	1,421	1,699,413	827
売 買 損	△ 235	△ 2,552,197	△ 13,692,530	△ 12,002,425	△ 317	△ 6,918,470
(C) 信 託 報 酬 等	△ 764,230	△ 818,567	△ 735,301	△ 914,505	△ 1,086,510	△ 916,018
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	32,840,295	523,278	△ 8,662,828	△ 7,774,657	5,774,740	△ 2,650,205
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△195,574,211	△162,176,860	△128,893,870	△137,556,698	△145,331,355	△139,556,615
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 67,898,298	△ 70,142,018	△183,030,515	△184,764,265	△186,509,904	△188,262,802
(配当等相当額)	(14,624,973)	(13,978,181)	(74,176,547)	(72,605,764)	(71,039,484)	(69,477,461)
(売買損益相当額)	(△ 82,523,271)	(△ 84,120,199)	(△257,207,062)	(△257,370,029)	(△257,549,388)	(△257,740,263)
(G) 計 (D+E+F)	△230,632,214	△231,795,600	△320,587,213	△330,095,620	△326,066,519	△330,469,622
(H) 収 益 分 配 金	△ 1,230,887	△ 1,233,270	△ 1,624,867	△ 1,625,416	△ 1,626,006	△ 1,626,635
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△231,863,101	△233,028,870	△322,212,080	△331,721,036	△327,692,525	△332,096,257
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 69,129,185	△ 71,375,288	△184,655,382	△186,389,681	△188,135,910	△189,889,437
(配当等相当額)	(13,394,086)	(12,744,911)	(72,551,690)	(70,980,348)	(69,413,478)	(67,850,826)
(売買損益相当額)	(△ 82,523,271)	(△ 84,120,199)	(△257,207,072)	(△257,370,029)	(△257,549,388)	(△257,740,263)
分 配 準 備 積 立 金	104,154,076	106,868,677	87,585,035	91,811,465	96,156,233	100,423,755
繰 越 損 益 金	△266,887,992	△268,522,259	△225,141,733	△237,142,820	△235,712,848	△242,630,575

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。

第61期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,785,804円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(14,624,973円)および分配準備積立金(100,368,272円)より分配対象収益は118,779,049円(10,000口当たり964円)であり、うち1,230,887円(10,000口当たり10円)を分配金額としております。

第62期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,071,132円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(13,978,181円)および分配準備積立金(103,797,545円)より分配対象収益は120,846,858円(10,000口当たり979円)であり、うち1,233,270円(10,000口当たり10円)を分配金額としております。

第63期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,373,700円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(74,176,557円)および分配準備積立金(85,211,335円)より分配対象収益は161,761,592円(10,000口当たり995円)であり、うち1,624,867円(10,000口当たり10円)を分配金額としております。

第64期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,226,430円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(72,605,764円)および分配準備積立金(87,585,035円)より分配対象収益は164,417,229円(10,000口当たり1,011円)であり、うち1,625,416円(10,000口当たり10円)を分配金額としております。

第65期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,344,768円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(71,039,484円)および分配準備積立金(91,811,465円)より分配対象収益は167,195,717円(10,000口当たり1,028円)であり、うち1,626,006円(10,000口当たり10円)を分配金額としております。

第66期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,267,522円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(69,477,461円)および分配準備積立金(96,156,233円)より分配対象収益は169,901,216円(10,000口当たり1,044円)であり、うち1,626,635円(10,000口当たり10円)を分配金額としております。

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンド監査は終了していません。

■分配金のお知らせ

決算期	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期
1万口当たり分配金	10円	10円	10円	10円	10円	10円

- ・分配金は税込みです。
- ・分配金を再投資する場合、お手持り分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資しました。

<課税上の取り扱い>

- ・分配金には、課税扱いとなる普通分配金と、非課税扱いとなる元本払戻金（特別分配金）があります。分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が元本払戻金（特別分配金）、残りの部分が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については配当所得として課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収されます。
- ・法人の場合は異なります。

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になる場合があります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

お知らせ

◆約款変更

該当事項はありません。

◆運用体制の変更

該当事項はありません。

【Bコース】

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第61期～第66期		項目の概要
	(2022年11月16日～2023年5月15日)		
	金額	比率	
平均基準価額	9,918円	—	作成期間の平均基準価額（月末値の平均値）です。
(a) 信託報酬 （投信会社） （販売会社） （受託会社）	42円 (14) (27) (1)	0.423% (0.136) (0.273) (0.014)	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 ・委託した資金の運用の対価 ・交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(d) 有価証券取引税	—	—	(d) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(e) その他費用 （監査費用） （印刷） （その他）	8 (5) (4) (0)	0.083 (0.046) (0.036) (0.002)	(e) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 その他費用 ・監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ・印刷は、印刷会社等に支払う法定書類の作成等に係る費用 ・その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	50	0.506	

* 作成期間の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

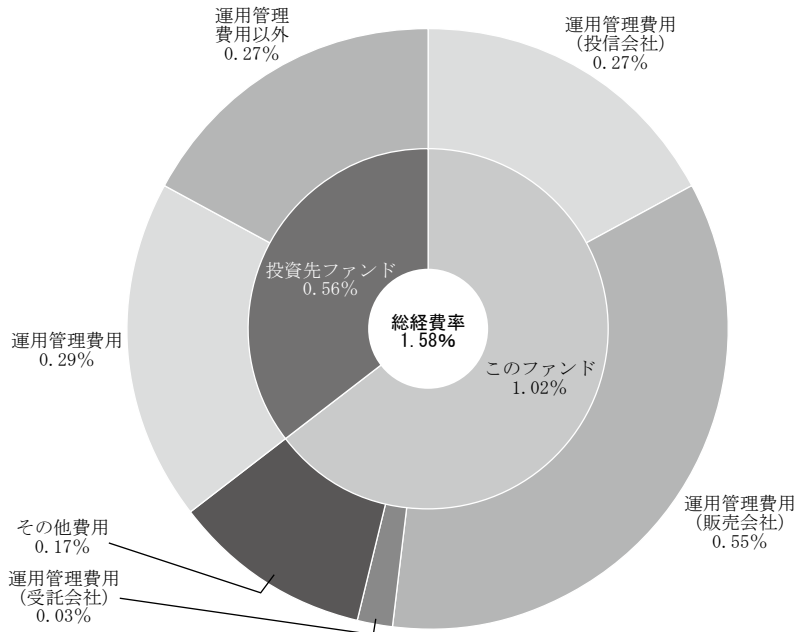
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（参考情報）

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.58%です。



総経費率 (①+②+③)	1.58%
①このファンドの費用の比率	1.02%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.29%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.27%

- *①の費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
- *各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。
- *各比率は、年率換算した値です。
- *投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
- *①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
- *①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
- *上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

■売買及び取引の状況（2022年11月16日から2023年5月15日まで）
投資信託証券

決算期 銘柄名	第 61 期 ～ 第 66 期			
	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
外国（ケイマン諸島） MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジなしクラス）	口	千円	口	千円
	50,650	47,479	253,959	236,944

（注1）金額は受渡代金です。

（注2）口数・金額の単位未満は切り捨てです。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

当作成期において、設定および解約はありません。

■利害関係人との取引状況等（2022年11月16日から2023年5月15日まで）
期中の利害関係人との取引状況

当ファンド

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

（注）利害関係人とは投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■第一種金融商品取引業又は第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己の取引状況
（2022年11月16日から2023年5月15日まで）

該当事項はありません。

■自社による当ファンドの設定・解約状況（2022年11月16日から2023年5月15日まで）
該当事項はありません。

■組入資産の明細（2023年5月15日現在）

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

決 算 期	第 11 作 成 期 末		
銘 柄	口 数	評 価 額	組 入 比 率
(ケイマン諸島)	口	千円	%
MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジなしクラス）	782,059	750,777	97.4
合 計	782,059	750,777	

(注1) 組入比率は、当作成期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

(2) 親投資信託残高

項 目	第10作成期末	第11作成期末	
	口 数	口 数	評 価 額
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 83	千口 83	千円 98

(注1) マザーファンドの2023年5月15日現在の受益権総口数は7,525,450千口です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

■有価証券の貸付及び借入の状況（2023年5月15日現在）

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

(2023年5月15日現在)

項 目	第 11 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 750,777	% 97.1
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	98	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	22,219	2.9
投 資 信 託 財 産 総 額	773,094	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨てております。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第61期末 2022年12月15日	第62期末 2023年1月16日	第63期末 2023年2月15日	第64期末 2023年3月15日	第65期末 2023年4月17日	第66期末 2023年5月15日
(A) 資 産	979,003,355円	928,004,765円	756,312,062円	759,480,320円	762,024,438円	773,094,553円
コール・ローン等	27,063,296	24,565,667	28,776,914	26,535,584	24,424,531	22,218,486
投資信託受益証券(評価額)	951,842,007	903,342,935	727,438,266	732,846,433	737,501,921	750,777,254
マニュアル・日本債券 インデックス・ マザーファンド(評価額)	98,052	96,163	96,882	98,303	97,986	98,813
(B) 負 債	2,742,098	2,769,178	2,265,855	2,135,958	2,239,783	2,140,617
未払収益分配金	1,930,924	1,931,425	1,528,579	1,528,631	1,528,684	1,528,753
未払解約金	204	—	98	—	—	201
未払信託報酬	692,257	711,343	618,321	496,619	580,778	501,016
その他未払費用	118,713	126,410	118,857	110,708	130,321	110,647
(C) 純資産総額(A-B)	976,261,257	925,235,587	754,046,207	757,344,362	759,784,655	770,953,936
元 本	965,462,050	965,712,641	764,289,958	764,315,868	764,342,212	764,376,603
次期繰越損益金	10,799,207	△ 40,477,054	△ 10,243,751	△ 6,971,506	△ 4,557,557	6,577,333
(D) 受 益 権 総 口 数	965,462,050口	965,712,641口	764,289,958口	764,315,868口	764,342,212口	764,376,603口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,112円	9,581円	9,866円	9,909円	9,940円	10,086円

(注1) 当ファンドの第61期首元本額は974,142,702円、第61～66期中追加設定元本額は52,037,512円、第61～66期中一部解約元本額は261,803,611円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第61期1.0112円、第62期0.9581円、第63期0.9866円、第64期0.9909円、第65期0.9940円、第66期1.0086円です。

(注3) 貸借対照表上の純資産総額が元本総額を下回っており、その差額は、第62期末40,477,054円、第63期末10,243,751円、第64期末6,971,506円、第65期末4,557,557円です。

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンド監査は終了していません。

■損益の状況

項 目	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期
	自 2022年11月16日 至 2022年12月15日	自 2022年12月16日 至 2023年1月16日	自 2023年1月17日 至 2023年2月15日	自 2023年2月16日 至 2023年3月15日	自 2023年3月16日 至 2023年4月17日	自 2023年4月18日 至 2023年5月15日
(A) 配 当 等 収 益	2,956,107円	2,965,240円	2,316,595円	2,324,084円	2,331,431円	2,338,801円
受 取 配 当 金	2,956,107	2,965,240	2,316,595	2,324,084	2,331,431	2,338,801
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,962,661	△ 51,466,200	21,152,493	3,085,504	2,323,740	10,937,355
売 買 益	2,958,782	—	26,465,929	3,085,504	2,324,057	10,937,359
売 買 損	3,879	△ 51,466,200	△ 5,313,436	—	△ 317	△ 4
(C) 信 託 報 酬 等	△ 812,600	△ 838,863	△ 738,887	△ 608,367	△ 712,283	△ 612,400
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	5,106,168	△ 49,339,823	22,730,201	4,801,221	3,942,888	12,663,756
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	67,769,572	70,974,738	14,829,074	37,559,275	42,360,496	46,303,341
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 60,145,609	△ 60,180,544	△ 46,274,447	△ 47,803,371	△ 49,332,257	△ 50,861,011
(配 当 等 相 当 額)	(30,227)	(33,243)	(5,048,130)	(3,522,957)	(1,997,804)	(473,778)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 60,175,836)	(△ 60,213,787)	(△ 51,322,577)	(△ 51,326,328)	(△ 51,330,061)	(△ 51,334,789)
(G) 計 (D+E+F)	12,730,131	△ 38,545,629	△ 8,715,172	△ 5,442,875	△ 3,028,873	8,106,086
(H) 収 益 分 配 金	△ 1,930,924	△ 1,931,425	△ 1,528,579	△ 1,528,631	△ 1,528,684	△ 1,528,753
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	10,799,207	△ 40,477,054	△ 10,243,751	△ 6,971,506	△ 4,557,557	6,577,333
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 60,175,539	△ 60,213,378	△ 47,803,026	△ 49,332,002	△ 50,860,941	△ 51,334,160
(配 当 等 相 当 額)	(297)	(409)	(3,519,553)	(1,994,326)	(469,120)	(629)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 60,175,836)	(△ 60,213,787)	(△ 51,322,579)	(△ 51,326,328)	(△ 51,330,061)	(△ 51,334,789)
分 配 準 備 積 立 金	125,794,064	126,021,933	96,931,531	98,994,344	100,969,168	102,144,452
繰 越 損 益 金	△ 54,819,318	△ 106,285,609	△ 59,372,256	△ 56,633,848	△ 54,665,784	△ 44,232,959

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。

第61期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,550,298円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(30,227円)および分配準備積立金(125,144,760円)より分配対象収益は127,725,285円(10,000口当たり1,322円)であり、うち1,930,924円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

第62期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,126,473円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(33,243円)および分配準備積立金(125,794,051円)より分配対象収益は127,953,767円(10,000口当たり1,324円)であり、うち1,931,425円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

第63期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,243,747円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(5,048,132円)および分配準備積立金(94,687,784円)より分配対象収益は101,979,663円(10,000口当たり1,334円)であり、うち1,528,579円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

第64期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,062,813円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(3,522,957円)および分配準備積立金(96,931,531円)より分配対象収益は102,517,301円(10,000口当たり1,341円)であり、うち1,528,631円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

第65期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,974,824円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,997,804円)および分配準備積立金(98,994,344円)より分配対象収益は102,966,972円(10,000口当たり1,347円)であり、うち1,528,684円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

第66期 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,230,980円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(473,778円)および分配準備積立金(100,969,076円)より分配対象収益は103,673,834円(10,000口当たり1,356円)であり、うち1,528,753円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンド監査は終了していません。

■分配金のお知らせ

決算期	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期
1万口当たり分配金	20円	20円	20円	20円	20円	20円

- ・分配金は税込みです。
- ・分配金を再投資する場合、お手持り分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資しました。

<課税上の取り扱い>

- ・分配金には、課税扱いとなる普通分配金と、非課税扱いとなる元本払戻金（特別分配金）があります。分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が元本払戻金（特別分配金）、残りの部分が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については配当所得として課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収されます。
- ・法人の場合は異なります。

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になる場合があります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

お知らせ

◆約款変更

該当事項はありません。

◆運用体制の変更

該当事項はありません。

【Cコース】

■ 1万口当たりの費用明細

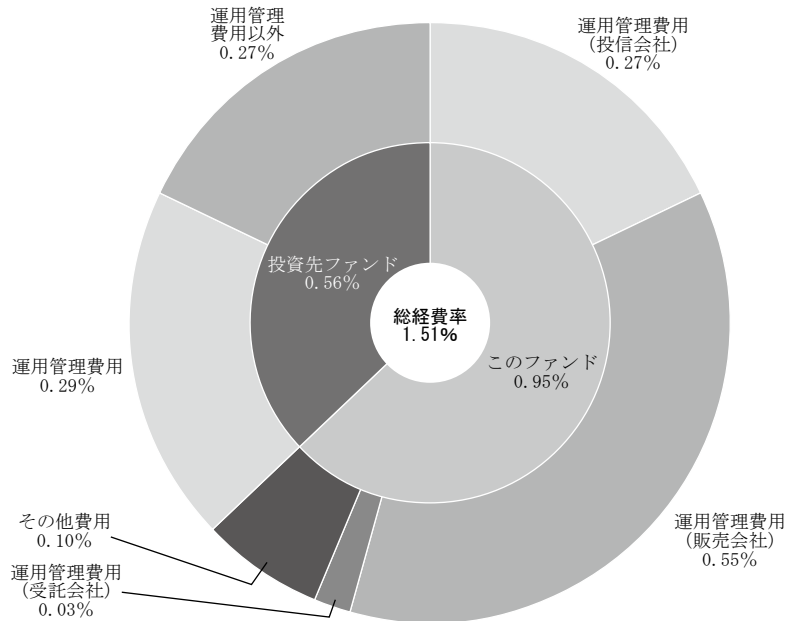
項目	当期		項目の概要
	(2022年11月16日～2023年5月15日)		
	金額	比率	
平均基準価額	8,521円	—	期中の平均基準価額（月末値の平均値）です。
(a) 信託報酬 （投信会社） （販売会社） （受託会社）	36円 (12) (23) (1)	0.423% (0.136) (0.273) (0.014)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ・委託した資金の運用の対価 ・交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(d) 有価証券取引税	—	—	(d) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(e) その他費用 （監査費用） （印刷） （その他）	4 (1) (3) (0)	0.049 (0.014) (0.033) (0.002)	(e) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他費用 ・監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ・印刷は、印刷会社等に支払う法定書類の作成等に係る費用 ・その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	40	0.472	

- * 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
* 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。
* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（参考情報）

■総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.51%です。



総経費率 (①+②+③)	1.51%
①このファンドの費用の比率	0.95%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.29%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.27%

- *①の費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
- *各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。
- *各比率は、年率換算した値です。
- *投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
- *①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
- *①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
- *上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

■売買及び取引の状況（2022年11月16日から2023年5月15日まで）
投資信託証券

銘 柄 名	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国（ケイマン諸島） MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジありクラス）	口 74,466	千円 54,308	口 439,331	千円 325,702

（注1）金額は受渡代金です。

（注2）口数・金額の単位未満は切り捨てです。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

当期において、設定および解約はありません。

■利害関係人との取引状況等（2022年11月16日から2023年5月15日まで）

期中の利害関係人との取引状況

当ファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

（注）利害関係人とは投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■第一種金融商品取引業又は第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己の取引状況

（2022年11月16日から2023年5月15日まで）

該当事項はありません。

■自社による当ファンドの設定・解約状況（2022年11月16日から2023年5月15日まで）

該当事項はありません。

■組入資産の明細（2023年5月15日現在）

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

決 算 期 末 銘 柄	当 期 末		
	口 数	評 価 額	組 入 比 率
(ケイマン諸島)	口	千円	%
MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジありクラス）	917,628	660,692	96.6
合 計	917,628	660,692	

(注1) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

(2) 親投資信託残高

項 目	期首（前期末）	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 83	千口 83	千円 98

(注1) マザーファンドの2023年5月15日現在の受益権総口数は7,525,450千口です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

■有価証券の貸付及び借入の状況（2023年5月15日現在）

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

(2023年5月15日現在)

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 660,692	% 96.0
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド	98	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	27,298	4.0
投 資 信 託 財 産 総 額	688,088	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨てております。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年5月15日
(A) 資 産	688,088,600円
コール・ローン等	27,297,591
投資信託受益証券(評価額)	660,692,196
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド(評価額)	98,813
(B) 負 債	4,035,419
未払信託報酬	3,624,339
その他未払費用	411,080
(C) 純資産総額(A-B)	684,053,181
元 本	802,075,727
次期繰越損益金	△118,022,546
(D) 受益権総口数	802,075,727口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,529円

(注1) 当ファンドの期首元本額は1,144,298,060円、期中追加設定元本額は56,016,754円、期中一部解約元本額は398,239,087円です。

(注2) 1口当たり純資産額は0.8529円です。

(注3) 貸借対照表上の純資産総額が元本総額を下回っており、その差額は118,022,546円です。

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年11月16日 至 2023年5月15日
(A) 配 当 等 収 益	16,488,494円
受 取 配 当 金	16,488,494
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	180,235
売 買 益	8,166,311
売 買 損	△ 7,986,076
(C) 信 託 報 酬 等	△ 4,052,163
(D) 当期損益金(A+B+C)	12,616,566
(E) 前期繰越損益金	△116,137,985
(F) 追加信託差損益金	△ 14,501,127
(配当等相当額)	(53,184,945)
(売買損益相当額)	(△ 67,686,072)
(G) 計 (D+E+F)	△118,022,546
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△118,022,546
追加信託差損益金	△ 14,501,127
(配当等相当額)	(53,184,946)
(売買損益相当額)	(△ 67,686,073)
分配準備積立金	72,526,094
繰越損益金	△176,047,513

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。
計算期間末における費用控除後の配当等収益(12,480,534円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(53,184,946円)および分配準備積立金(60,045,560円)より分配対象収益は125,711,040円(10,000口当たり1,567円)ですが、当期に分配した金額はありません。

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンド監査は終了していません。

お知らせ

◆約款変更

該当事項はありません。

◆運用体制の変更

該当事項はありません。

【Dコース】

■ 1万口当たりの費用明細

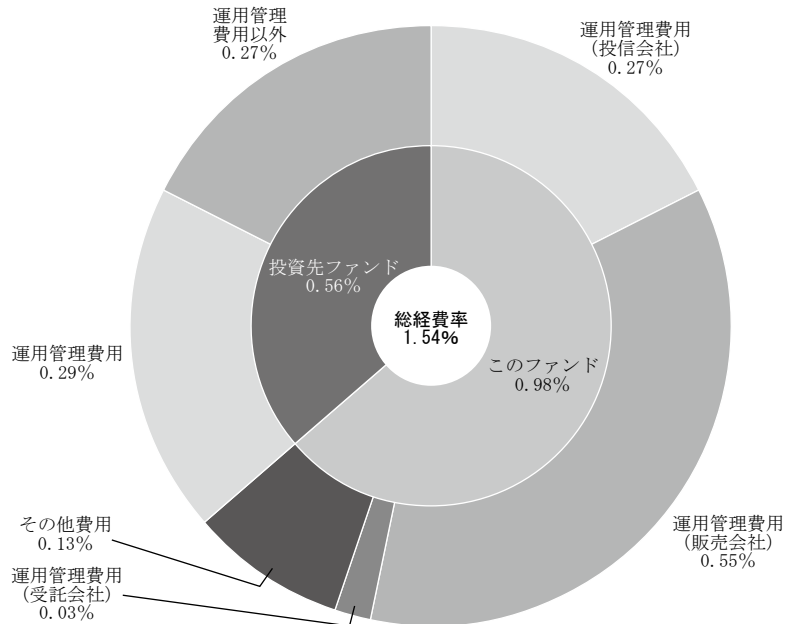
項目	当期		項目の概要
	(2022年11月16日～2023年5月15日)		
	金額	比率	
平均基準価額	11,251円	—	期中の平均基準価額（月末値の平均値）です。
(a) 信託報酬 （投信会社） （販売会社） （受託会社）	48円 (15) (31) (2)	0.423% (0.136) (0.273) (0.014)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ・委託した資金の運用の対価 ・交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	—	—	(c) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(d) 有価証券取引税	—	—	(d) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(e) その他費用 （監査費用） （印刷） （その他）	7 (3) (4) (0)	0.064 (0.023) (0.039) (0.002)	(e) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他費用 ・監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ・印刷は、印刷会社等に支払う法定書類の作成等に係る費用 ・その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	55	0.487	

- * 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
* 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。
* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（参考情報）

■総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.54%です。



総経費率 (①+②+③)	1.54%
①このファンドの費用の比率	0.98%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.29%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.27%

- *①の費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
- *各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。
- *各比率は、年率換算した値です。
- *投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
- *①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
- *①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
- *上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

■売買及び取引の状況（2022年11月16日から2023年5月15日まで）
投資信託証券

銘 柄 名	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国（ケイマン諸島） MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジなしクラス）	45,190	42,976	282,592	263,659

（注1）金額は受渡代金です。

（注2）口数・金額の単位未満は切り捨てです。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

当期において、設定および解約はありません。

■利害関係人との取引状況等（2022年11月16日から2023年5月15日まで）

期中の利害関係人との取引状況

当ファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

（注）利害関係人とは投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■第一種金融商品取引業又は第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己の取引状況

（2022年11月16日から2023年5月15日まで）

該当事項はありません。

■自社による当ファンドの設定・解約状況（2022年11月16日から2023年5月15日まで）

該当事項はありません。

■組入資産の明細（2023年5月15日現在）

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

決 算 期 末 銘 柄	当 期 末		
	口 数	評 価 額	組 入 比 率
(ケイマン諸島)	口	千円	%
MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジなしクラス）	432,017	414,737	96.3
合 計	432,017	414,737	

(注1) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

(2) 親投資信託残高

項 目	期首（前期末）	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	千口 83	千口 83	千円 98

(注1) マザーファンドの2023年5月15日現在の受益権総口数は7,525,450千口です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

■有価証券の貸付及び借入の状況（2023年5月15日現在）

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

(2023年5月15日現在)

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 414,737	% 95.7
マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド	98	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	18,313	4.3
投 資 信 託 財 産 総 額	433,148	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨てております。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年5月15日
(A) 資 産	433,148,669円
コール・ローン等	18,312,711
投資信託受益証券(評価額)	414,737,145
マニュアル・日本債券インデックス・マザーファンド(評価額)	98,813
(B) 負 債	2,488,855
未 払 解 約 金	229
未 払 信 託 報 酬	2,162,359
そ の 他 未 払 費 用	326,267
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	430,659,814
元 本	373,633,937
次 期 繰 越 損 益 金	57,025,877
(D) 受 益 権 総 口 数	373,633,937口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,526円

(注1) 当ファンドの期首元本額は586,396,270円、期中追加設定元本額は41,786,840円、期中一部解約元本額は254,549,173円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1.1526円です。

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年11月16日 至 2023年5月15日
(A) 配 当 等 収 益	7,711,592円
受 取 配 当 金	7,711,592
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	473,526
売 買 益	8,059,935
売 買 損	△7,586,409
(C) 信 託 報 酬 等	△2,499,476
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	5,685,642
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	33,182,435
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	18,157,800
(配 当 等 相 当 額)	(28,335,981)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△10,178,181)
(G) 計 (D+E+F)	57,025,877
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	57,025,877
追 加 信 託 差 損 益 金	18,157,800
(配 当 等 相 当 額)	(28,335,983)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△10,178,183)
分 配 準 備 積 立 金	45,649,598
繰 越 損 益 金	△6,781,521

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。
計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,357,046円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(28,335,983円)および分配準備積立金(40,292,552円)より分配対象収益は73,985,581円(10,000口当たり1,980円)ですが、当期に分配した金額はありません。

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンド監査は終了していません。

お知らせ

◆約款変更

該当事項はありません。

◆運用体制の変更

該当事項はありません。

<参考情報>

■組入投資信託証券の概要

MIT-US・コア・フィクスト・インカム・ファンド クラスA（円建て為替ヘッジありクラス
 ／円建て為替ヘッジなしクラス）

管 理 会 社	マニュアル・インベストメント・マネジメント（HK）リミテッド
投資顧問会社	マニュアル・インベストメント・マネジメント（US）LLC（実質的な運用を行います。）
信 託 期 間	無期限
運 用 方 針	<p>①米ドル建ての債券（米国国債、社債、モーゲージ証券、資産担保証券等を含みます。）等に分散投資を行います。</p> <p>・原則として、債券の格付けは、取得時において投資適格とします。</p> <p>②景気動向や投資環境の変化を捉え、債券の配分及びボトム・アップに基づく銘柄選択とイールド・カーブ戦略を融合することで収益の獲得をめざします。</p> <p>③原則として、円建て為替ヘッジありクラスは、対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。円建て為替ヘッジなしクラスは、対円での為替ヘッジを行いません。</p> <p>④資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p>
投 資 制 限	<p>・投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%を超えないものとします。</p> <p>・株式への投資は行いません。</p>

■投資対象とする投資信託証券の資産の状況

当ファンドの運用報告書作成時点において、入手可能な直前計算期間の「マニュライフ・インベストメンツ・トラストーUS・コア・フィクスト・インカム・ファンド」の情報を委託会社が抜粋・翻訳したものを記載しております。

■費用の明細

(2022年1月1日から2022年12月31日まで)
(単位：米ドル)

マネジメントフィー	(320,857)
カストディーフィー等	(69,811)
事務手数料	(12,000)
監査報酬等	(34,695)
評価手数料	(93,600)
取引手数料	(9,699)
年間権限費用	(1,458)
会計及びその他専門家費用	(5,658)
ディストリビューションおよびエージェントフィー	(729,891)
その他費用	(23,220)
費用合計	<u>(1,300,889)</u>

■有価証券明細表 2022年12月31日

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
AAL 2 7/8 07/11/34	87,000.00	70,270.80	0.06
AAL 3 1/2 02/15/32	21,610.73	16,436.73	0.01
AAL 3.15 02/15/32	31,983.89	26,556.02	0.02
AAL 3.575 01/15/28	75,009.87	67,108.14	0.06
AAL 3.6 10/15/29	59,759.43	46,908.94	0.04
AAL 3.65 02/15/29	128,406.25	113,850.72	0.10
AAL 4.1 01/15/28	53,577.05	43,732.75	0.04
AAL 5.9 10/01/24	127,883.40	123,811.91	0.11
ABC 2.8 05/15/30	173,000.00	147,133.09	0.13
ABDLF 2020-1A A	130,000.00	118,552.44	0.10
ABENGO 6 7/8 04/30/43	208,902.00	189,578.57	0.17
ABIBB 4.6 04/15/48	120,000.00	104,887.69	0.09
ABIBB 4.9 02/01/46	64,000.00	58,503.41	0.05
ADC 2021-1A A2	299,000.00	255,985.26	0.22
ADSEZ 3.1 02/02/31	200,000.00	147,010.81	0.13
ADSK 2.85 01/15/30	74,000.00	63,789.86	0.06
AER 1 3/4 01/30/26	190,000.00	167,361.78	0.15
AER 1.65 10/29/24	136,000.00	125,537.89	0.11
AER 2 7/8 08/14/24	185,000.00	175,267.46	0.15
AER 2.45 10/29/26	558,000.00	488,661.81	0.43
AES 4 3/8 05/31/30	200,000.00	174,209.00	0.15
AESOP 2019-3A A	294,000.00	273,928.80	0.24
AESOP 2020-1A A	128,000.00	118,601.52	0.10
AHTLN 1 1/2 08/12/26	200,000.00	170,921.66	0.15
AKERBP 3 01/15/25	70,000.00	66,428.14	0.06
AKERBP 3.1 07/15/31	200,000.00	164,520.44	0.14
AKERBP 4 01/15/31	198,000.00	174,009.90	0.15
AL 2 7/8 01/15/26	87,000.00	80,592.74	0.07
AL 2.1 09/01/28	95,000.00	77,547.66	0.07
AL 3 5/8 12/01/27	64,000.00	57,996.49	0.05
ALK 8 08/15/25	107,370.39	108,466.28	0.09
AMCAR 2020-1 C	42,000.00	40,651.47	0.04
AMH 4 1/4 02/15/28	93,000.00	86,155.06	0.08
AMSR 2020-SFR4 A	113,000.00	101,193.35	0.09
AMSR 2021-SFR1 B	167,000.00	134,900.83	0.12
AMT 3.8 08/15/29	225,000.00	204,601.34	0.18
AN 4 3/4 06/01/30	83,000.00	74,241.01	0.06
AOMT 2020-R1 A1	54,741.84	51,172.50	0.04
AOMT 2021-2 A1	54,576.13	45,054.73	0.04
AOMT 2021-4 A1	119,757.79	94,762.28	0.08
AOMT 2021-5 A1	151,651.93	124,423.74	0.11
APEXC 2020-1A A1R	276,000.00	270,504.56	0.24
AQFIT 2021-A A	67,945.92	62,164.55	0.05
ARCC 2 7/8 06/15/28	140,000.00	112,483.71	0.10
ARCC 2.15 07/15/26	217,000.00	183,980.37	0.16
ARCC 3 7/8 01/15/26	166,000.00	152,307.96	0.13
ARCC 4.2 06/10/24	120,000.00	115,909.09	0.10
ARRW 2021-1R A1	93,055.60	73,531.82	0.06
ATH 3 1/2 01/15/31	293,000.00	241,264.48	0.21
AVGO 3.419 04/15/33	218,000.00	175,378.02	0.15
AVGO 4 3/4 04/15/29	502,000.00	479,231.19	0.42
AVGO 4.926 05/15/37	94,000.00	82,339.95	0.07
BA 3.2 03/01/29	86,000.00	75,584.14	0.07
BA 5.04 05/01/27	240,000.00	237,735.18	0.21
BA 5.15 05/01/30	346,000.00	338,419.72	0.30
BABSN 2013-1A AR	255,000.00	166,797.68	0.15
BAC 2.087 06/14/29	264,000.00	222,619.59	0.19
BAC 2.592 04/29/31	224,000.00	182,925.65	0.16
BAC 2.687 04/22/32	400,000.00	321,113.94	0.28
BAC 3.248 10/21/27	184,000.00	170,200.25	0.15
BAC 3.846 03/08/37	181,000.00	150,344.10	0.13
BAC 4.271 07/23/29	356,000.00	332,642.07	0.29
BBCMS 2015-SRCH D	100,000.00	85,072.26	0.07
BBCMS 2020-C6 A2	74,000.00	69,816.02	0.06
BCRED 2.35 11/22/24	154,000.00	141,052.20	0.12
BCRED 2.7 01/15/25	119,000.00	110,031.09	0.10
BCRED 3 1/4 03/15/27	34,000.00	28,671.98	0.03
BCRED 4 01/15/29	167,000.00	138,075.54	0.12
BEACN 2021-1A A	224,366.67	190,536.98	0.17

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
BELL 2021-1A A2I	298,980.00	253,565.15	0.22
BKNG 4 5/8 04/13/30	170,000.00	164,599.87	0.14
BMARK 2019-B12 A2	171,641.31	164,133.89	0.14
BMARK 2019-B13 A2	65,000.00	62,055.62	0.05
BOCA 2022-BOCA A	107,000.00	105,066.12	0.09
BPCEGP 4 1/2 03/15/25	200,000.00	192,268.04	0.17
BPR 2022-OANA A	323,000.00	315,975.49	0.28
BRAVO 2021-NQM1 A1	61,213.42	51,042.61	0.04
BX 2020-VKNG A	140,735.71	137,497.48	0.12
BX 2021-ACNT A	106,000.00	102,144.49	0.09
BX 2021-CJP A	289,000.00	279,323.10	0.24
BX 2021-MFM1 D	58,000.00	54,657.21	0.05
BX 2021-VOLT C	158,000.00	148,715.15	0.13
BX 2022-AHP A	244,000.00	233,960.96	0.20
BX 2022-CLS A	117,000.00	114,782.80	0.10
BXHPP 2021-FILM C	358,000.00	323,081.32	0.28
C 2.561 05/01/32	119,000.00	94,230.01	0.08
C 4.6 03/09/26	325,000.00	319,610.60	0.28
CARMX 2022-4 A3	157,000.00	158,632.38	0.14
CAS 2022-R03 1M1	129,042.72	128,210.80	0.11
CAS 2022-R04 1M1	55,280.34	55,111.34	0.05
CAS 2022-R06 1M1	73,262.00	74,214.62	0.06
CAUTO 2020-1A A1	111,643.12	104,153.52	0.09
CCI 3.65 09/01/27	255,000.00	237,269.36	0.21
CCI 3.8 02/15/28	70,000.00	65,179.49	0.06
CF 2019-CF1 A2	232,000.00	225,237.25	0.20
CFG 3 1/4 04/30/30	260,000.00	226,297.44	0.20
CGCMT 2019-PRM A	140,000.00	137,546.65	0.12
CGCMT 2019-SMRT A	123,000.00	119,983.99	0.10
CGCMT 2020-GC46 A2	150,000.00	140,918.48	0.12
CGMS 2019-2A A1R	345,000.00	337,229.57	0.29
CHH 3.7 01/15/31	91,000.00	77,364.02	0.07
CHH 3.7 12/01/29	143,000.00	124,848.41	0.11
CHTR 4.2 03/15/28	242,000.00	222,849.80	0.19
CHTR 4.8 03/01/50	241,000.00	175,902.93	0.15
CHTR 5 3/4 04/01/48	342,000.00	281,397.56	0.25
CHTR 6.484 10/23/45	274,000.00	248,250.06	0.22
CLIF 2020-1A A	338,682.50	293,789.39	0.26
CLIF 2021-1A A	191,027.03	162,930.40	0.14
CLIF 2022-1A A	128,538.67	109,443.82	0.10
CLR 4.9 06/01/44	84,000.00	62,422.39	0.05
CNA 2.05 08/15/30	64,000.00	50,543.54	0.04
CNO 5 1/4 05/30/29	184,000.00	175,694.06	0.15
COLO 2021-1A A2	312,000.00	270,817.22	0.24
COLO 2021-2A A2	141,000.00	122,365.47	0.11
COLT 2020-RPL1 A1	212,813.63	181,525.51	0.16
COLT 2021-2 A1	126,758.20	100,621.74	0.09
COLT 2021-3 A1	171,299.92	133,269.93	0.12
COLT 2021-HX1 A1	141,950.29	113,937.75	0.10
COMM 2018-COR3 XA	571,169.30	10,869.41	0.01
COMM 2020-CX D	100,000.00	69,463.61	0.06
COXENT 2.95 10/01/50	50,000.00	30,191.74	0.03
CSGP 2.8 07/15/30	250,000.00	204,732.29	0.18
CSMC 2019-ICE4 D	122,000.00	119,582.50	0.10
CSMC 2020-NET A	146,597.86	131,141.87	0.11
CSMC 2021-AFC1 A1	205,736.06	160,047.91	0.14
CSMC 2021-NQM2 A1	94,692.17	78,861.56	0.07
CSMC 2021-NQM3 A1	83,476.42	66,039.90	0.06
CSMC 2021-NQM5 A1	85,551.42	66,412.53	0.06
CSMC 2021-NQM6 A1	145,094.23	113,461.03	0.10
CSMC 2021-RPL2 A1A	190,204.07	152,687.99	0.13
CVS 4.3 03/25/28	87,000.00	84,312.29	0.07
CVS 5.05 03/25/48	141,000.00	127,271.58	0.11
D 3 3/8 04/01/30	121,000.00	106,906.13	0.09
DAL 2.9 10/28/24	74,000.00	70,226.61	0.06
DAL 4 1/2 10/20/25	40,000.00	39,045.00	0.03
DAL 4 3/4 10/20/28	134,102.00	126,258.31	0.11
DAL 4 3/8 04/19/28	59,000.00	52,687.24	0.05
DB 2.311 11/16/27	150,000.00	127,372.95	0.11
DB 2.552 01/07/28	229,000.00	194,960.58	0.17
DBJPM 2020-C9 A2	166,000.00	151,577.41	0.13

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
DELL 4.9 10/01/26	285,000.00	280,920.58	0.25
DELL 5.3 10/01/29	122,000.00	119,594.89	0.10
DFS 4.1 02/09/27	102,000.00	96,129.77	0.08
DFS 6.7 11/29/32	147,000.00	149,863.01	0.13
DIN 2019-1A A2I	250,470.00	246,896.85	0.22
DLTR 4.2 05/15/28	288,000.00	276,004.51	0.24
DNFRA 2021-1A A	211,000.00	173,291.89	0.15
DNKN 2017-1A A2II	74,295.00	67,788.65	0.06
DNKN 2021-1A A2I	334,620.00	286,715.63	0.25
DPABS 2017-1A A23	238,125.00	219,050.81	0.19
DPABS 2019-1A A2	70,992.50	61,549.23	0.05
DPABS 2021-1A A2I	172,375.00	143,895.65	0.13
DRMT 2021-2 A1	128,218.71	108,360.85	0.09
DUBAEE 3 3/8 03/20/28	200,000.00	177,818.00	0.16
EART 2021-1A C	54,735.96	53,550.33	0.05
EBAY 2.7 03/11/30	247,000.00	210,376.37	0.18
EFMT 2021-2 A1	98,202.33	76,018.76	0.07
EHGVT 2019-A A	105,360.98	97,808.82	0.09
EMACN 3.55 06/15/26	110,000.00	103,173.91	0.09
ENBCN 5 3/4 07/15/2080	162,000.00	146,888.29	0.13
ENBCN 6 1/4 03/01/2078	153,000.00	139,444.65	0.12
EPD 5 1/4 08/16/2077	233,000.00	187,713.08	0.16
EQIX 1.8 07/15/27	66,000.00	56,592.61	0.05
EQT 7 02/01/30	56,000.00	58,172.80	0.05
ET 4.2 04/15/27	103,000.00	97,360.47	0.08
ET 5 1/2 06/01/27	158,000.00	157,131.37	0.14
ET 5 1/4 04/15/29	364,000.00	352,746.03	0.31
ET 5.15 03/15/45	95,000.00	79,030.48	0.07
ET 5.4 10/01/47	125,000.00	106,439.89	0.09
EXPE 2.95 03/15/31	105,000.00	84,681.61	0.07
EXPE 3.8 02/15/28	353,000.00	324,668.96	0.28
EXPE 4 5/8 08/01/27	181,000.00	173,937.07	0.15
EXPE 5 02/15/26	172,000.00	169,930.91	0.15
FANG 3 1/8 03/24/31	120,000.00	99,658.35	0.09
FCX 4 1/4 03/01/30	155,000.00	141,001.23	0.12
FCX 5.45 03/15/43	187,000.00	169,103.17	0.15
FG G60989	130,459.79	117,769.84	0.10
FG G61158	108,653.01	104,997.13	0.09
FG G67701	174,078.78	157,635.57	0.14
FG Q44455	103,514.63	96,776.64	0.08
FG V81612	534,255.80	500,982.53	0.44
FKH 2020-SFR1 A	261,549.58	233,930.39	0.20
FKH 2020-SFR2 A	194,809.69	172,773.95	0.15
FKH 2021-SFR1 A	111,218.13	96,569.29	0.08
FKH 2021-SFR1 C	254,000.00	215,704.01	0.19
FLEX 6 01/15/28	179,000.00	178,931.64	0.16
FMEGR 2 3/8 02/16/31	286,000.00	210,366.48	0.18
FMEGR 3 3/4 06/15/29	250,000.00	212,238.29	0.19
FN AS6187	159,239.66	149,084.70	0.13
FN BM1179	220,934.35	199,601.14	0.17
FN BM1277	186,538.73	179,804.56	0.16
FN BM3641	49,740.21	47,897.92	0.04
FN BM5950	28,279.53	25,566.56	0.02
FN BO1040	48,424.03	43,248.88	0.04
FN BO1420	27,496.57	25,427.29	0.02
FN BO1439	21,060.30	18,809.56	0.02
FN BR0464	-	-	0.00
FN CA0713	90,456.89	89,205.18	0.08
FN CA2457	16,686.40	16,037.08	0.01
FN CA4149	50,118.46	44,480.30	0.04
FN CA4546	75,831.48	67,727.25	0.06
FN CA5540	572,287.73	512,736.01	0.45
FN CA8062	2,306,134.95	1,981,318.03	1.73
FN CB3865	254,003.35	247,650.84	0.22
FN CB4028	475,314.44	462,535.83	0.40
FN CB4088	964,007.32	914,143.41	0.80
FN CB4304	282,673.37	273,218.77	0.24
FN CB4395	470,464.43	454,728.78	0.40
FN CB4908	500,709.69	507,212.98	0.44
FN FM1253	71,274.59	64,258.74	0.06
FN FM1347	17,587.85	15,856.61	0.01

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
FN FM1588	71,989.19	64,633.04	0.06
FN FM1715	35,585.70	32,205.18	0.03
FN FM1790	47,833.59	42,452.48	0.04
FN FM1864	37,178.99	33,217.23	0.03
FN FM2075	669,319.17	599,879.62	0.52
FN FM2178	103,224.74	95,391.95	0.08
FN FM2274	182,308.44	175,000.60	0.15
FN FM3327	123,808.51	118,584.48	0.10
FN FM3860	146,227.36	140,011.68	0.12
FN FM4583	1,073,658.61	891,475.76	0.78
FN FM4877	2,129,834.07	1,838,834.10	1.60
FN FM6184	1,253,526.74	1,039,256.21	0.91
FN FM8161	111,246.06	95,472.87	0.08
FN FM8451	275,309.99	236,274.74	0.21
FN FM9726	302,297.68	260,664.02	0.23
FN FM9977	137,518.52	131,393.70	0.11
FN FS0194	336,342.76	287,602.81	0.25
FN FS0703	29,228.36	27,862.65	0.02
FN FS0715	2,181,602.94	1,936,520.90	1.69
FN FS1133	650,282.67	619,389.73	0.54
FN FS1602	87,855.53	84,299.52	0.07
FN FS1637	59,107.96	56,069.04	0.05
FN FS1976	319,278.55	306,355.54	0.27
FN FS2131	1,061,738.23	1,011,464.23	0.88
FN FS2167	583,711.05	568,018.24	0.50
FN FS2238	591,389.38	565,049.99	0.49
FN FS2354	16,231.94	15,454.47	0.01
FN FS2415	63,440.96	61,582.73	0.05
FN FS2616	1,021,049.02	1,022,196.93	0.89
FN FS2896	392,526.15	383,813.22	0.33
FN FS2969	700,944.02	685,385.13	0.60
FN FS3276	131,768.85	131,199.08	0.11
FN FS3310	414,614.76	412,692.37	0.36
FN FS3359	436,384.14	443,552.03	0.39
FN FS3405	167,000.00	170,943.40	0.15
FN FS3417	228,000.00	227,045.08	0.20
FNCL 4.5 1/23	583,000.00	580,130.56	0.51
FNCL 5 1/23	- 1,257,000.00	- 1,240,894.63	-1.08
FNCL 5 1/23	1,257,000.00	1,240,894.63	1.08
FNCL 5.5 1/23	- 613,000.00	- 615,490.28	-0.54
FNCL 5.5 1/23	613,000.00	615,490.28	0.54
FNS 427 C20	826,012.52	96,179.87	0.08
FNS 427 C77	392,385.42	59,430.86	0.05
Foothill-Eastern Transportation Corridor Agency 4.094 15-Jan-49	139,000.00	105,404.58	0.09
FR QA5174	133,045.48	119,242.47	0.10
FR QA6328	116,040.42	104,219.20	0.09
FR QA6367	208,838.61	187,172.33	0.16
FR QA7075	484,800.53	434,352.65	0.38
FR QE1497	15,760.95	14,982.15	0.01
FR RA1573	234,901.20	218,251.18	0.19
FR RA1776	44,588.97	39,963.02	0.03
FR RA1860	167,165.27	149,195.58	0.13
FR RA6432	99,585.79	84,874.57	0.07
FR RA6944	1,472,069.29	1,344,036.58	1.17
FR RA7195	3,434,147.88	3,159,073.84	2.76
FR RA7942	559,311.61	568,149.10	0.50
FR RA8248	438,063.07	433,627.35	0.38
FR SB8199	79,132.21	78,790.04	0.07
FR SD0100	31,440.91	28,179.02	0.02
FR SD0436	317,596.82	273,111.72	0.24
FR SD0742	304,985.89	262,219.53	0.23
FR SD1050	132,777.87	129,208.20	0.11
FR SD1324	1,166,121.39	1,104,345.35	0.96
FR SD1446	334,361.56	325,894.84	0.28
FR SD1454	81,206.03	78,827.44	0.07
FR SD1475	407,412.24	397,095.72	0.35
FR SD1517	228,987.16	223,618.08	0.20
FR SD1606	203,029.07	196,711.01	0.17
FR SD1695	234,669.92	233,613.73	0.20
FR SD1944	115,853.64	115,368.41	0.10
FR SD2032	230,000.00	229,467.95	0.20

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
FR SD7526	-	-	0.00
FR ZT100	153,712.74	138,582.17	0.12
FSMT 2021-1 A2	183,969.95	148,788.09	0.13
GCAT 2021-NQM1 A1	65,837.93	55,575.85	0.05
GCAT 2021-NQM2 A1	69,646.30	54,471.63	0.05
GCAT 2021-NQM3 A1	114,053.28	91,260.64	0.08
GCPAF 2020-1A A2	100,000.00	91,436.26	0.08
GCPAF 2021-1A A2	137,000.00	124,035.72	0.11
GLPI 3 1/4 01/15/32	68,000.00	54,456.43	0.05
GLPI 4 01/15/30	63,000.00	55,288.11	0.05
GLPI 5 3/8 04/15/26	102,000.00	100,235.11	0.09
GM 2.4 10/15/28	360,000.00	299,167.35	0.26
GM 3.6 06/21/30	376,000.00	317,263.36	0.28
GM 5.4 10/15/29	163,000.00	155,912.56	0.14
GNR 2017-169 IO	1,765,935.34	60,839.30	0.05
GNR 2017-20 IO	275,136.44	7,306.08	0.01
GNR 2017-41 IO	132,661.64	3,841.28	0.00
GNR 2018-114 IO	105,817.39	4,356.85	0.00
GNR 2018-158 IO	191,889.78	9,786.32	0.01
GNR 2018-35 IO	228,986.54	8,691.15	0.01
GNR 2018-43 IO	286,024.01	9,757.45	0.01
GNR 2018-69 IO	176,390.50	8,240.91	0.01
GNR 2018-9 IO	330,842.26	10,391.09	0.01
GNR 2018-99 IO	200,568.52	7,495.65	0.01
GNR 2019-131 IO	130,486.81	7,290.68	0.01
GNR 2020-100 IO	131,541.15	7,866.67	0.01
GNR 2020-108 IO	1,653,188.38	99,974.58	0.09
GNR 2020-118 IO	691,871.68	43,681.11	0.04
GNR 2020-119 IO	129,395.81	6,637.09	0.01
GNR 2020-137 IO	2,067,619.61	119,529.92	0.10
GNR 2020-150 IO	939,637.14	67,639.73	0.06
GNR 2020-170 IO	771,264.22	49,713.92	0.04
GNR 2020-92 IO	152,510.29	10,170.61	0.01
GNR 2021-10 IO	643,866.74	47,519.62	0.04
GNR 2021-11 IO	997,635.11	71,974.29	0.06
GNR 2021-110 IO	682,908.31	47,639.75	0.04
GNR 2021-163 IO	798,269.59	51,314.84	0.04
GNR 2021-183 IO	583,798.90	38,589.28	0.03
GNR 2021-203 IO	1,422,500.70	97,008.86	0.08
GNR 2021-3 IO	1,555,286.52	102,269.89	0.09
GNR 2021-40 IO	1,818,863.11	118,427.81	0.10
GNR 2022-17 IO	884,776.82	59,702.44	0.05
GNR 2022-181 IO	394,332.02	29,752.17	0.03
GNR 2022-21 IO	384,505.20	25,185.17	0.02
GNR 2022-53 IO	1,391,986.64	79,291.67	0.07
Golden State Tobacco Securitization Corp 4.214 01-Jun-50	101,000.00	79,081.61	0.07
GS 2.615 04/22/32	489,000.00	391,146.22	0.34
GS 2.65 10/21/32	177,000.00	140,195.10	0.12
GSMS 2021-NQM1 A1	42,040.19	34,679.93	0.03
GSMS 2019-GC40 A2	115,000.00	110,530.81	0.10
GSMS 2021-STAR A	269,000.00	258,626.28	0.23
HART 2022-C A3	210,000.00	212,310.04	0.19
HCA 4 1/8 06/15/29	254,000.00	232,410.29	0.20
HGVT 2019-AA A	57,690.56	54,241.09	0.05
HGVT 2018-AA A	27,929.45	27,015.34	0.02
HIFI 2022-1A A2	130,000.00	116,725.28	0.10
HII 4.2 05/01/30	102,000.00	92,815.97	0.08
HONK 2018-1A A2	77,355.00	72,160.78	0.06
HONK 2020-2A A2	137,550.00	114,203.58	0.10
HONK 2021-1A A2	194,040.00	154,523.33	0.13
HPA 2021-2 A	64,690.77	55,967.65	0.05
HST 3 1/2 09/15/30	96,000.00	79,440.94	0.07
HST 3 3/8 12/15/29	195,000.00	163,423.05	0.14
HST 4 06/15/25	279,000.00	268,349.44	0.23
HST 4 1/2 02/01/26	87,000.00	83,467.14	0.07
HWIRE 2021-1 A2	94,000.00	81,720.27	0.07
HYNMTR 1.8 10/15/25	100,000.00	90,041.20	0.08
HYNMTR 2 3/8 10/15/27	50,000.00	42,855.24	0.04
IAGLN 4 1/4 11/15/32	32,232.14	28,924.00	0.03
IAGLN 4 5/8 06/20/24	74,286.37	72,164.82	0.06
IAGLN 8 3/8 11/15/28	66,050.57	64,948.80	0.06

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
ICOT 2013-IRV A2	120,000.00	118,637.46	0.10
IMPRL 2021-NQM1 A1	67,841.24	55,090.24	0.05
JACK 2022-1A A2I	167,450.00	145,791.82	0.13
JBLU 2 3/4 05/15/32	89,185.49	73,797.88	0.06
JBSSBZ 5 1/8 02/01/28	67,000.00	63,599.59	0.06
JBSSBZ 5 3/4 04/01/33	183,000.00	174,999.24	0.15
JPM 2.522 04/22/31	243,000.00	199,380.44	0.17
JPM 2.956 05/13/31	251,000.00	207,365.45	0.18
JPM 3.96 01/29/27	232,000.00	221,415.58	0.19
JPM 4.6 PERP	199,000.00	175,866.25	0.15
JPM 6 3/4 PERP	262,000.00	261,152.43	0.23
JPMCC 2022-OPO A	135,000.00	115,648.48	0.10
KHC 4 3/8 06/01/46	270,000.00	220,641.60	0.19
KHC 5 06/04/42	76,000.00	69,087.14	0.06
KHC 5 1/2 06/01/50	68,000.00	65,362.55	0.06
KLAC 4.1 03/15/29	153,000.00	147,954.77	0.13
KMI 4.15 08/15/26	45,000.00	42,857.43	0.04
KMI 7 3/4 03/15/32	83,000.00	92,202.01	0.08
KNDL 2019-KNSQ C	179,000.00	175,035.62	0.15
KSA 4 3/8 04/16/29	200,000.00	197,915.60	0.17
KSA 4 3/8 04/16/29	314,000.00	310,727.49	0.27
LAZ 4 3/8 03/11/29	99,000.00	91,632.22	0.08
LIFE 2021-BMR A	159,241.16	154,395.39	0.13
LIFE 2021-BMR D	123,854.24	117,591.81	0.10
LIFE 2022-BMR2 A1	305,000.00	297,909.94	0.26
LLOYDS 4.45 05/08/25	394,000.00	386,812.01	0.34
LVLTL 3.4 03/01/27	140,000.00	118,542.96	0.10
MAR 4 5/8 06/15/30	106,000.00	99,164.95	0.09
MAR 4.65 12/01/28	274,000.00	263,642.42	0.23
Maryland Health & Higher Educational Facilities Authority 3.197 01-Jul-50	300,000.00	196,974.33	0.17
MCAF 2021-1A A2	257,000.00	236,479.04	0.21
MET 6.4 12/15/36	129,000.00	124,919.09	0.11
MFRA 2021-NQM1 A1	59,116.93	51,290.84	0.04
MHP 2022-MHIL A	153,522.05	147,244.78	0.13
Mississippi Hospital Equipment & Facilities Authority 3.72 01-Sep-26	36,000.00	33,892.66	0.03
MPLX 4 03/15/28	139,000.00	129,533.68	0.11
MPLX 4 1/4 12/01/27	101,000.00	95,610.47	0.08
MPLX 4 1/8 03/01/27	45,000.00	42,569.62	0.04
MPLX 4.95 09/01/32	79,000.00	74,309.76	0.06
MQGAU 3.624 06/03/30	200,000.00	162,137.02	0.14
MQGAU 4 7/8 06/10/25	200,000.00	195,812.05	0.17
MS 2.239 07/21/32	88,000.00	67,723.84	0.06
MS 2.484 09/16/36	296,000.00	215,307.43	0.19
MSI 2 3/4 05/24/31	203,000.00	162,796.72	0.14
MSI 2.3 11/15/30	239,000.00	187,428.65	0.16
MSI 4.6 05/23/29	68,000.00	64,864.54	0.06
MTB 5 1/8 PERP	60,000.00	51,790.41	0.05
MU 4.185 02/15/27	303,000.00	287,324.47	0.25
MU 4.975 02/06/26	158,000.00	155,608.16	0.14
MU 5.327 02/06/29	393,000.00	378,053.49	0.33
MVWOT 2018-1A A	182,034.99	176,423.05	0.15
NAVSL 2016-AA A2A	28,618.24	27,703.39	0.02
NAVSL 2019-FA A2	83,945.85	77,733.25	0.07
NAVSL 2020-2A A1A	71,705.06	60,163.46	0.05
NAVSL 2020-GA A	65,444.98	58,078.60	0.05
NAVSL 2020-HA A	223,541.51	200,788.38	0.18
NAVSL 2021-A A	151,961.46	131,519.51	0.11
NBLY 2021-1A A2	283,680.00	228,166.60	0.20
NBLY 2022-1A A2	108,182.50	86,188.77	0.08
NEE 2 1/4 06/01/30	58,000.00	47,828.35	0.04
NEM 2.8 10/01/29	63,000.00	53,692.17	0.05
New Jersey Transportation Trust Fund Authority 4.081 15-Jun-39	199,000.00	165,110.26	0.14
New Jersey Transportation Trust Fund Authority 4.131 15-Jun-42	10,000.00	8,060.79	0.01
NI 3.6 05/01/30	103,000.00	91,954.44	0.08
NIPLIF 2 3/4 01/21/51	207,000.00	166,398.55	0.15
NLT 2021-INV1 A1	207,532.61	166,498.23	0.15
NRG 2.45 12/02/27	142,000.00	117,875.01	0.10
NRG 4.45 06/15/29	107,000.00	94,840.24	0.08
NRZT 2020-1A A1B	117,111.44	106,607.36	0.09
NSANY 1 1/8 09/16/24	92,000.00	83,888.00	0.07
NWG 1.6 09/29/26	261,000.00	226,960.10	0.20

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
NWG 3.754 11/01/29	200,000.00	185,639.34	0.16
NXPI 3 7/8 06/18/26	243,000.00	231,149.25	0.20
NYLIFE 3 3/4 05/15/50	115,000.00	88,502.54	0.08
OBX 2021-NQM2 A1	130,350.82	99,869.81	0.09
OBX 2021-NQM3 A1	159,972.97	121,042.97	0.11
OC 3.95 08/15/29	148,000.00	134,830.25	0.12
OCTR 2020-10A AR	125,000.00	121,175.50	0.11
Ohio Turnpike & Infrastructure Commission 3.216 15-Feb-48	35,000.00	25,021.99	0.02
OMPT 2017-1MKT D	100,000.00	92,451.71	0.08
ORCL 2.95 04/01/30	370,000.00	316,298.18	0.28
OVV 7.2 11/01/31	23,000.00	24,216.50	0.02
OXFIN 2019-1A A2	49,844.08	49,460.10	0.04
OXFIN 2020-1A A2	44,910.01	44,423.05	0.04
PFMT 2020-F1 A2	115,096.92	98,816.81	0.09
PNC 3.15 05/19/27	20,000.00	18,706.62	0.02
PNC 3.4 PERP	261,000.00	207,495.00	0.18
PNC 4.85 PERP	106,000.00	99,971.25	0.09
PNC Float PERP	116,000.00	116,115.81	0.10
PROG 2020-SFR1 A	99,820.50	91,083.14	0.08
PROG 2021-SFR2 A	356,681.28	311,991.50	0.27
PROG 2021-SFR5 A	282,791.31	243,639.42	0.21
PROG 2021-SFR8 B	105,000.00	86,962.89	0.08
PRU 5 1/8 03/01/52	83,000.00	75,642.88	0.07
QATAR 5.103 04/23/48	200,000.00	201,478.20	0.18
QRVO 1 3/4 12/15/24	122,000.00	112,514.50	0.10
QRVO 3 3/8 04/01/31	113,000.00	90,989.18	0.08
Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue 3.006 15-May-50	270,000.00	178,882.48	0.16
RPRX 1 3/4 09/02/27	50,000.00	42,396.80	0.04
SANTAN 4.379 04/12/28	200,000.00	188,021.78	0.16
SANUSA 2.49 01/06/28	146,000.00	125,459.20	0.11
SANUSA 3.244 10/05/26	344,000.00	319,716.69	0.28
SANUSA 3.45 06/02/25	316,000.00	301,398.81	0.26
SANUSA 4.4 07/13/27	73,000.00	69,735.10	0.06
SBATOW 6.599 01/15/28	47,000.00	47,201.99	0.04
SCFET 2019-2A C	203,000.00	191,879.21	0.17
SCFET 2021-1A B	122,000.00	109,701.59	0.10
SCFET 2022-2A A3	247,000.00	249,664.73	0.22
SECBEN 5 02/18/31	159,000.00	125,387.03	0.11
SESAC 2019-1 A2	213,817.50	198,304.59	0.17
SLG 2021-OVA C	286,000.00	218,819.74	0.19
SMB 2019-B A2A	278,870.72	260,903.86	0.23
SMB 2020-PTA A2A	118,974.44	105,785.80	0.09
SMB 2021-A APT2	79,231.10	68,017.23	0.06
SMRT 2022-MINI A	342,000.00	330,583.42	0.29
SONIC 2020-1A A2I	178,730.00	159,303.05	0.14
SONIC 2021-1A A2I	142,200.00	113,821.84	0.10
SORT 2020-1 A1	355,146.04	317,390.71	0.28
SORT 2021-1A A1	194,150.98	168,142.47	0.15
SPLLLC 4 1/2 05/15/30	279,000.00	259,272.33	0.23
SPLLLC 4.2 03/15/28	85,000.00	80,050.54	0.07
SPLLLC 5 03/15/27	149,000.00	146,325.93	0.13
SPRO 2021-1A A2	147,750.00	116,116.65	0.10
SRFC 2021-1A A	88,816.56	82,250.93	0.07
STACR 2022-DNA1 M1A	156,086.23	152,159.88	0.13
STACR 2022-DNA2 M1A	103,747.34	102,070.36	0.09
STACR 2022-DNA2 M1B	150,000.00	146,078.90	0.13
STACR 2022-DNA3 M1A	137,076.81	136,455.46	0.12
STACR 2022-DNA3 M1B	87,000.00	86,091.39	0.08
STACR 2022-DNA4 M1A	100,839.59	100,575.55	0.09
STACR 2022-DNA4 M1B	126,000.00	126,847.79	0.11
STACR 2022-DNA5 M1B	203,000.00	212,545.83	0.19
STAR 2021-2 A1	74,936.42	69,514.05	0.06
STAR 2022-1 A1	149,089.18	125,505.60	0.11
State Board of Administration Finance Corp 1.705 01-Jul-27	112,000.00	97,597.24	0.09
T 2 1/2 02/15/45	2,791,000.00	2,103,879.77	1.84
T 3 08/15/52	9,409,000.00	7,755,074.22	6.77
T 3 1/2 06/01/41	248,000.00	185,909.52	0.16
T 3 7/8 11/30/27	526,000.00	523,205.63	0.46
T 3.65 06/01/51	265,000.00	187,840.29	0.16
T 4 1/2 11/30/24	1,024,000.00	1,024,120.00	0.89
T 4 1/4 10/15/25	230,000.00	229,856.25	0.20

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
T 4 1/8 11/15/32	2,828,000.00	2,886,548.42	2.52
T 4 11/15/42	2,472,000.00	2,421,015.00	2.11
T 4 11/15/52	967,000.00	968,662.03	0.85
TAH 2020-SFR2 A	190,940.87	158,291.70	0.14
TAOT 2022-D A3	183,000.00	185,241.79	0.16
TCF 2020-1A A	93,006.25	79,744.42	0.07
TCF 2021-1A A	200,895.00	167,894.36	0.15
TELEFO 5.213 03/08/47	218,000.00	175,960.62	0.15
TIAAGL 4.27 05/15/47	193,000.00	158,732.29	0.14
TIF 2020-1A A	281,506.67	242,063.67	0.21
TIF 2021-1A A	107,283.75	89,185.06	0.08
TMUS 3 7/8 04/15/30	278,000.00	252,468.64	0.22
TOWN 2022-STAY A	189,000.00	188,234.70	0.16
TPMT 2018-1 A1	99,183.36	95,956.95	0.08
TPMT 2018-6 A1A	53,263.04	51,837.57	0.05
TPMT 2019-1 A1	75,021.99	70,932.91	0.06
TPMT 2019-4 A1	130,232.19	121,538.30	0.11
TPMT 2020-4 A1	106,263.35	94,412.46	0.08
TRGP 4 01/15/32	146,000.00	123,040.04	0.11
TRGP 4.95 04/15/52	175,000.00	139,236.55	0.12
TRPCN 4 1/4 05/15/28	114,000.00	108,125.70	0.09
UAL 3 3/4 09/03/26	193,931.12	178,749.55	0.16
UAL 3.45 07/07/28	153,123.97	129,199.48	0.11
UAL 3.65 01/07/26	44,250.02	40,098.10	0.03
UAL 4 7/8 01/15/26	56,388.00	53,710.38	0.05
UAL 4.55 08/25/31	99,860.19	84,200.27	0.07
UAL 4.6 03/01/26	10,757.00	9,881.89	0.01
UAL 5 7/8 10/15/27	311,411.04	307,465.21	0.27
UHS 1.65 09/01/26	153,000.00	131,335.93	0.11
UHS 2.65 10/15/30	160,000.00	127,710.36	0.11
USRE 2021-1 A1	264,000.00	223,554.62	0.20
VCRRRL 2021-1A A	70,973.29	64,387.24	0.06
VDC 2019-1A A2	191,399.99	182,056.92	0.16
VDC 2020-1A A2	181,000.00	159,852.16	0.14
VDC 2020-2A A2	130,000.00	107,077.85	0.09
VERUS 2020-5 A1	34,380.30	31,341.48	0.03
VERUS 2021-1 A1	110,785.34	92,845.64	0.08
VERUS 2021-3 A1	119,246.15	95,808.02	0.08
VERUS 2021-5 A1	121,940.66	97,936.83	0.09
VERUS 2021-R1 A1	50,189.15	45,040.03	0.04
VERUS 2021-R2 A1	62,016.43	56,505.39	0.05
VICI 4 1/8 08/15/30	40,000.00	35,073.80	0.03
VICI 4 3/8 05/15/25	52,000.00	50,576.65	0.04
VICI 4 5/8 12/01/29	80,000.00	72,934.40	0.06
VICI 5 1/8 05/15/32	31,000.00	28,764.13	0.03
VINE 2020-1A A	211,464.21	176,297.41	0.15
VISIO 2020-1R A1	106,638.44	96,442.03	0.08
VMW 4.7 05/15/30	239,000.00	222,887.04	0.19
VRSN 2.7 06/15/31	83,000.00	67,804.37	0.06
VST 3.55 07/15/24	240,000.00	230,323.61	0.20
VST 3.7 01/30/27	289,000.00	263,706.62	0.23
VST 4.3 07/15/29	232,000.00	209,220.25	0.18
VSTNA 2017-A A	48,576.57	46,508.97	0.04
VTRS 2.3 06/22/27	100,000.00	85,592.31	0.07
VTRS 2.7 06/22/30	119,000.00	93,290.95	0.08
VTRS 4 06/22/50	136,000.00	84,264.39	0.07
VZ 4.329 09/21/28	356,000.00	343,001.49	0.30
VZOT 2020-C C	171,000.00	163,145.95	0.14
WBD 5.05 03/15/42	59,000.00	45,348.87	0.04
WBD 5.141 03/15/52	215,000.00	157,127.87	0.14
WDC 4 3/4 02/15/26	167,000.00	157,634.64	0.14
WEN 2021-1A A21	186,165.00	150,904.21	0.13
WFC 2.393 06/02/28	393,000.00	347,450.09	0.30
WFC 2.879 10/30/30	299,000.00	254,610.91	0.22
WFC 3.068 04/30/41	175,000.00	125,472.71	0.11
WFC 3.35 03/02/33	131,000.00	110,705.84	0.10
WFC 5 7/8 PERP	456,000.00	441,180.00	0.39
WFCM 2019-C51 A2	68,521.29	66,387.83	0.06
WMB 3 3/4 06/15/27	198,000.00	186,681.17	0.16
WMB 4.65 08/15/32	113,000.00	105,525.38	0.09
WSTOP 2020-1A A2	312,840.00	265,631.32	0.23

銘柄名	数量	評価額(米ドル)	投資比率(%)
ZAXBY 2021-1A A2	123,437.50	99,841.95	0.09
有価証券 合計		113,757,621.79	99.27
その他資産		831,419.39	0.73
純資産総額		114,589,041.18	100.00

マニユライフ・日本債券インデックス・マザーファンド

第14期

決算日 2023年2月15日

(計算期間：2022年2月16日から2023年2月15日まで)

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2009年2月13日から無期限です。
主要投資対象	NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。
運用方針	①主としてNOMURA-BPI総合に採用されている公社債に投資することにより、同インデックスの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。 ②公社債の組入比率は原則として高位を維持します。 ③資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。
投資制限	①債券への投資割合は、制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合*		株式 組入比率	債券 組入比率	投資信託 証券比率	純資産 総額
	期 騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク) 期 騰 落 率	騰 落 率				
10期 (2019年2月15日)	円	%		%	%	%	%	百万円
	12,156	1.6	12,185	1.6	—	98.7	—	14,666
11期 (2020年2月17日)	12,296	1.2	12,328	1.2	—	99.4	—	13,257
12期 (2021年2月15日)	12,129	△1.4	12,152	△1.4	—	99.3	—	12,225
13期 (2022年2月15日)	11,991	△1.1	12,010	△1.2	—	99.2	—	10,678
14期 (2023年2月15日)	11,587	△3.4	11,596	△3.4	—	99.2	—	8,986

(注1) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

(注2) 当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI総合（以下「ベンチマーク」といいます。）です。当ベンチマークは、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

※ベンチマークに関して

NOMURA-BPI総合とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表しているわが国の債券市場全体の動向を反映する投資収益指数（パフォーマンス）で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI総合は、同社の知的財産であり、同指数に関する一切の権利は同社に帰属します。同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合*		株式 組入比率	債券 組入比率	投資信託 証券比率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク) 騰 落 率	騰 落 率			
(期首) 2022年2月15日	円	%		%	%	%	%
	11,991	—	12,010	—	—	99.2	—
2月末	12,027	0.3	12,043	0.3	—	99.2	—
3月末	11,994	0.0	12,009	△0.0	—	99.0	—
4月末	11,964	△0.2	11,980	△0.2	—	99.5	—
5月末	11,947	△0.4	11,962	△0.4	—	99.3	—
6月末	11,841	△1.3	11,853	△1.3	—	99.2	—
7月末	11,919	△0.6	11,931	△0.7	—	98.9	—
8月末	11,890	△0.8	11,903	△0.9	—	99.2	—
9月末	11,767	△1.9	11,775	△2.0	—	99.4	—
10月末	11,756	△2.0	11,764	△2.0	—	99.1	—
11月末	11,702	△2.4	11,703	△2.6	—	98.9	—
12月末	11,544	△3.7	11,554	△3.8	—	99.1	—
2023年1月末	11,513	△4.0	11,522	△4.1	—	99.0	—
(期末) 2023年2月15日							
	11,587	△3.4	11,596	△3.4	—	99.2	—

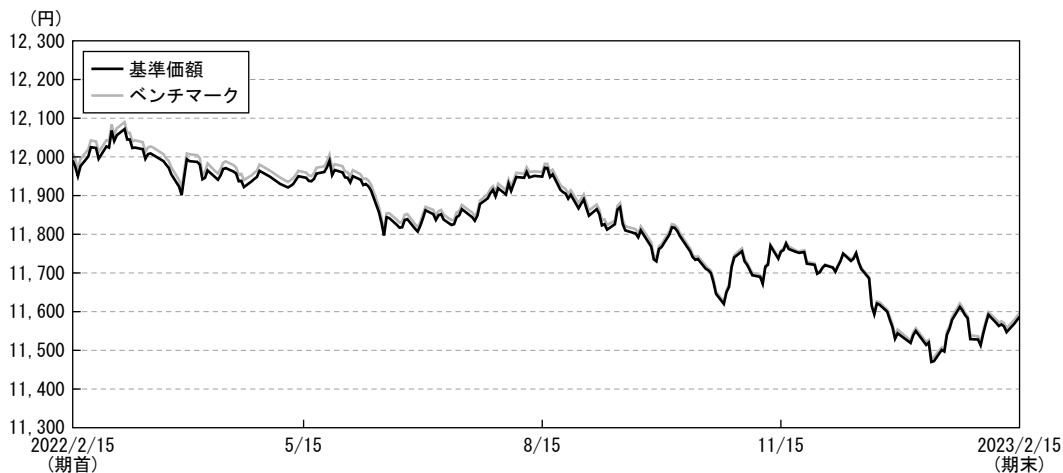
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 基準価額は1万円当たりで表示しています。

(注3) 当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。当ベンチマークは、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

運用経過

■基準価額等の推移（2022年2月16日から2023年2月15日まで）



期 首：11,991円

期 末：11,587円

騰 落 率：△3.4%

※当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。当ベンチマークは、ファンドの設定日の前営業日を10,000として、委託会社が算出したものです。

■基準価額の変動要因

資産のほぼ全額を債券に投資したことにより、債券市況とほぼ同様の推移となりました。

■投資環境

10年国債利回りは、米国をはじめとしてインフレ長期化懸念や金融政策正常化シフトなどからグローバルに金利が上昇する中、日銀も追隨してハト派姿勢を後退させるとの思惑が強まったことなどから、2022年3月後半にかけてYCC（イールドカーブ・コントロール）政策の変動許容幅の上限である0.25%まで上昇しました。その後は、日銀が各種オペを通じて上昇を抑制する中、概ね横ばいで推移しました。12月以降は日銀の上限引き上げに伴い0.5%近辺まで上昇し、その後はボラティリティが高まる局面がありつつも2023年2月以降は0.5%近辺で概ね横ばいの展開となりました。こうした中、10年国債利回りは、期末には0.51%（2月15日）となり前期末（0.22%）に比べ上昇しました。

■当該投資信託のポートフォリオ

当ファンドは、主に、NOMURA-BPI総合に採用されている公社債に投資することにより、当該インデックスの動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

■当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドの、当期の基準価額の騰落率は3.4%の低下となりました。同期間におけるベンチマーク（NOMURA-BPI総合）の騰落率は3.4%の低下となり、ベンチマークに沿った運用を行った結果、基準価額はベンチマークと同様の動きとなりました。

■今後の運用方針

当ファンドの運用の基本方針に従い、今後もNOMURA-BPI総合に採用されている公社債に投資することにより、当該インデックスの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年2月16日～2023年2月15日)		
	金額	比率	
平均基準価額	11,822円	—	期中の平均基準価額（月末値の平均値）です。
(a) その他費用	0円	0.001%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他費用
（その他）	(0)	(0.001)	・その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	0	0.001	

* 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況（2022年2月16日から2023年2月15日まで）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	1,671,765	2,588,477
	地方債証券	—	200,631
	特殊債証券	—	100,478 (27,188)
内	社債券（投資法人債券を含む）	99,899	— (100,000)

(注1) 金額は受け渡し代金です。（経過利子分は含まれておりません。）

(注2) 単位未満は切り捨てております。

(注3) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等（2022年2月16日から2023年2月15日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細（2023年2月15日現在）

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	決 算 期		当 期		末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	内BB格以下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	6,945,000 (270,000)	7,187,751 (302,094)	80.0 (3.4)	— (—)	59.4 (3.4)	17.2 (—)	3.3 (—)
地 方 債 証 券	600,000 (600,000)	611,565 (611,565)	6.8 (6.8)	— (—)	3.4 (3.4)	3.4 (3.4)	— (—)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	498,866 (498,866)	500,280 (500,280)	5.6 (5.6)	— (—)	0.6 (0.6)	1.1 (1.1)	3.9 (3.9)
金 融 債 証 券	100,000 (100,000)	99,525 (99,525)	1.1 (1.1)	— (—)	— (—)	1.1 (1.1)	— (—)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	500,000 (500,000)	515,573 (515,573)	5.7 (5.7)	— (—)	3.5 (3.5)	1.1 (1.1)	1.1 (1.1)
合 計	8,643,866 (1,968,866)	8,914,694 (2,029,038)	99.2 (22.6)	— (—)	66.9 (10.8)	24.0 (6.7)	8.3 (5.0)

(注1) ()内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 額面金額・評価額の単位未満は切り捨てです。

(注4) —印は組入れがありません。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債

銘 柄	決 算 期	当 期	期		償 還 年 月 日	
			利 率	額 面 金 額		評 価 額
				千円	千円	
国債証券		%		千円	千円	
第428回利付国債（2年）		0.005		200,000	200,166	2023/9/1
第438回利付国債（2年）		0.005		100,000	100,130	2024/7/1
第1回利付国債（40年）		2.4		120,000	144,560	2048/3/20
第6回利付国債（40年）		1.9		50,000	55,059	2053/3/20
第7回利付国債（40年）		1.7		20,000	21,048	2054/3/20
第8回利付国債（40年）		1.4		20,000	19,545	2055/3/20
第9回利付国債（40年）		0.4		30,000	21,468	2056/3/20
第11回利付国債（40年）		0.8		50,000	40,555	2058/3/20
第13回利付国債（40年）		0.5		50,000	36,065	2060/3/20
第15回利付国債（40年）		1.0		50,000	41,879	2062/3/20
第339回利付国債（10年）		0.4		200,000	202,108	2025/6/20
第345回利付国債（10年）		0.1		200,000	200,190	2026/12/20
第346回利付国債（10年）		0.1		70,000	69,971	2027/3/20
第351回利付国債（10年）		0.1		280,000	277,785	2028/6/20
第356回利付国債（10年）		0.1		230,000	226,147	2029/9/20

決 算 期	当 期	末			
		銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額
国債証券	%		千円	千円	
第358回利付国債 (10年)	0.1		300,000	293,997	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)	0.1		40,000	39,088	2030/6/20
第366回利付国債 (10年)	0.2		200,000	194,952	2032/3/20
第2回利付国債 (30年)	2.4		200,000	227,900	2030/2/20
第6回利付国債 (30年)	2.4		41,000	47,616	2031/11/20
第15回利付国債 (30年)	2.5		50,000	59,580	2034/6/20
第18回利付国債 (30年)	2.3		110,000	128,967	2035/3/20
第21回利付国債 (30年)	2.3		100,000	117,467	2035/12/20
第25回利付国債 (30年)	2.3		70,000	82,365	2036/12/20
第28回利付国債 (30年)	2.5		120,000	144,544	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4		190,000	226,337	2038/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3		80,000	93,943	2040/3/20
第34回利付国債 (30年)	2.2		90,000	104,148	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0		50,000	56,251	2041/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8		50,000	54,459	2043/3/20
第40回利付国債 (30年)	1.8		50,000	54,414	2043/9/20
第44回利付国債 (30年)	1.7		50,000	53,416	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5		50,000	51,482	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5		50,000	51,451	2045/3/20
第48回利付国債 (30年)	1.4		50,000	50,389	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4		40,000	40,243	2045/12/20
第51回利付国債 (30年)	0.3		100,000	78,508	2046/6/20
第55回利付国債 (30年)	0.8		60,000	52,510	2047/6/20
第62回利付国債 (30年)	0.5		70,000	55,622	2049/3/20
第65回利付国債 (30年)	0.4		30,000	22,959	2049/12/20
第66回利付国債 (30年)	0.4		70,000	53,369	2050/3/20
第68回利付国債 (30年)	0.6		70,000	56,170	2050/9/20
第70回利付国債 (30年)	0.7		70,000	57,568	2051/3/20
第74回利付国債 (30年)	1.0		80,000	71,321	2052/3/20
第78回利付国債 (20年)	1.9		54,000	56,459	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0		100,000	105,265	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1		20,000	21,104	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1		100,000	106,011	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0		100,000	105,727	2025/12/20
第90回利付国債 (20年)	2.2		100,000	107,727	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3		260,000	281,023	2026/9/20
第94回利付国債 (20年)	2.1		70,000	75,684	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3		200,000	218,680	2027/6/20
第100回利付国債 (20年)	2.2		140,000	154,023	2028/3/20

決 算 期 銘 柄 名	当 期			末	
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
国債証券	%	千円	千円		
第121回利付国債 (20年)	1.9	100,000	110,766	2030/9/20	
第124回利付国債 (20年)	2.0	80,000	89,323	2030/12/20	
第125回利付国債 (20年)	2.2	200,000	226,958	2031/3/20	
第127回利付国債 (20年)	1.9	100,000	111,098	2031/3/20	
第129回利付国債 (20年)	1.8	20,000	22,108	2031/6/20	
第133回利付国債 (20年)	1.8	80,000	88,880	2031/12/20	
第139回利付国債 (20年)	1.6	10,000	10,957	2032/6/20	
第141回利付国債 (20年)	1.7	100,000	110,478	2032/12/20	
第144回利付国債 (20年)	1.5	80,000	86,848	2033/3/20	
第145回利付国債 (20年)	1.7	50,000	55,273	2033/6/20	
第147回利付国債 (20年)	1.6	50,000	54,727	2033/12/20	
第148回利付国債 (20年)	1.5	220,000	238,352	2034/3/20	
第154回利付国債 (20年)	1.2	50,000	52,138	2035/9/20	
第157回利付国債 (20年)	0.2	80,000	72,939	2036/6/20	
第158回利付国債 (20年)	0.5	100,000	94,640	2036/9/20	
第164回利付国債 (20年)	0.5	50,000	46,297	2038/3/20	
第174回利付国債 (20年)	0.4	30,000	26,190	2040/9/20	
第175回利付国債 (20年)	0.5	70,000	61,979	2040/12/20	
第179回利付国債 (20年)	0.5	80,000	69,890	2041/12/20	
第182回利付国債 (20年)	1.1	50,000	48,476	2042/9/20	
小 計		6,945,000	7,187,751		
地方債証券					
第13回東京都公募公債	1.93	100,000	109,108	2042/3/19	
第792回東京都公募公債	0.05	200,000	194,910	2029/3/19	
平成28年度第2回静岡県公募公債	0.08	100,000	99,879	2026/3/19	
第161回共同発行市場公募地方債	0.06	100,000	99,649	2026/8/25	
第19回公営企業債券	2.37	100,000	108,019	2026/12/18	
小 計		600,000	611,565		
特殊債券 (除く金融債)					
第103回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	99,450	2027/12/17	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.605	149,000	149,257	2023/5/31	
第88回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.06	100,000	100,003	2023/3/20	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	19,146	19,886	2046/7/10	
第75回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	30,720	31,671	2048/8/10	
第50回東日本高速道路株式会社社債	0.08	100,000	100,012	2023/6/20	
小 計		498,866	500,280		
金融債券					
第377回信金中金債	0.04	100,000	99,525	2026/4/27	
小 計		100,000	99,525		

決 算 期 銘 柄 名	当 期			期 末	
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
普通社債券（含む投資法人債券）	%	千円	千円		
第389回中国電力株式会社社債	0.3	100,000	99,499	2026/4/24	
第81回三菱商事株式会社無担保社債	1.518	100,000	107,010	2032/6/25	
第81回三井不動産株式会社無担保社債	0.689	100,000	99,129	2032/7/14	
第45回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.321	100,000	109,874	2029/6/19	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	0.69	100,000	100,061	2023/3/20	
小 計		500,000	515,573		
合 計		8,643,866	8,914,694		

(注) 額面金額・評価額の単位未満は切り捨てです。

■有価証券の貸付及び借入の状況（2023年2月15日現在）

該当事項はありません。

(2023年2月15日現在)

■投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 8,914,694	% 99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	72,719	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	8,987,413	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨てております。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年2月15日
(A) 資 産	8,987,413,944円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	39,437,848
公 社 債(評価額)	8,914,694,799
未 収 利 息	31,765,341
前 払 費 用	1,515,956
(B) 負 債	870,206
未 払 解 約 金	867,849
そ の 他 未 払 費 用	2,357
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	8,986,543,738
元 本	7,756,030,494
次 期 繰 越 損 益 金	1,230,513,244
(D) 受 益 権 総 口 数	7,756,030,494口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,587円

(注1) 当親ファンドの期首元本額は8,905,980,044円、期中追加設定元本額は614,387,077円、期中一部解約元本額は1,764,336,627円です。

(注2) 当親ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は以下の通りです。

マニユライフ・日本債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	2,763,370,796円
マニユライフ・国際分散ファンド20(適格機関投資家専用)	4,262,690,244円
マニユライフ・国際分散ファンド75(適格機関投資家専用)	613,937,038円
マニユライフ・国際分散ファンド50(適格機関投資家専用)	115,220,319円
マニユライフ・アジア経済圏・小型成長株ファンド	91,845円
マニユライフ・変動高金利戦略ファンド Aコース(為替ヘッジあり・毎月)	91,450円
マニユライフ・変動高金利戦略ファンド Bコース(為替ヘッジなし・毎月)	91,450円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年2月16日 至 2023年2月15日
(A) 配 当 等 収 益	103,128,499円
受 取 利 息	103,128,499
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 433,085,641
売 買 益	1,129,600
売 買 損	△ 434,215,241
(C) 信 託 報 酬 等	△ 70,945
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 330,028,087
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,772,824,266
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	111,152,560
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 323,435,495
(H) 計 (D+E+F+G)	1,230,513,244
次 期 繰 越 損 益 金(H)	1,230,513,244

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

マニュライフ・変動高金利戦略ファンド Cコース (為替ヘッジあり・年2回)	91,450円
マニュライフ・変動高金利戦略ファンド Dコース (為替ヘッジなし・年2回)	91,450円
マニュライフ・米国投資適格債券戦略ファンド Aコース (為替ヘッジあり・毎月)	83,613円
マニュライフ・米国投資適格債券戦略ファンド Bコース (為替ヘッジなし・毎月)	83,613円
マニュライフ・米国投資適格債券戦略ファンド Cコース (為替ヘッジあり・年2回)	83,613円
マニュライフ・米国投資適格債券戦略ファンド Dコース (為替ヘッジなし・年2回)	83,613円
マニュライフ・ストラテジック・インカム・ファンド (為替ヘッジなし) <ラップ>	10,000円
マニュライフ・ストラテジック・インカム・ファンド (為替ヘッジあり) <ラップ>	10,000円

(注3) 1口当たり純資産額は1,1587円です。

※当ファンドは監査対象ではありません。

お知らせ

◆約款変更

ホームページアドレスの変更に伴い、信託約款に所要の変更を行いました。

(2022年6月24日)

◆運用体制の変更

該当事項はありません。